

単体流動性カバレッジ比率に関する定量的開示事項

(単位:百万円、%、件)

項目		当四半期 (2021/1-3)		前四半期 (2020/10-12)	
適格流動資産 (1)					
1	適格流動資産の合計額	27,244,933		27,807,462	
資金流出額 (2)					
		資金流出率を 乗じる前の額	資金流出率を 乗じた後の額	資金流出率を 乗じる前の額	資金流出率を 乗じた後の額
2	リテール無担保資金調達に係る資金流出額	41,533	4,118	41,736	4,137
3	うち、安定預金の額	500	15	513	15
4	うち、準安定預金の額	41,033	4,103	41,223	4,122
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	10,657,390	7,638,609	11,226,534	8,193,993
6	うち、適格オペレーショナル預金の額	-	-	-	-
7	うち、適格オペレーショナル預金及び負債性有価証券以外のホール セール無担保資金調達に係る資金の額	9,906,985	6,888,204	10,571,324	7,538,784
8	うち、負債性有価証券の額	750,404	750,404	655,209	655,209
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		344,212		223,197
10	デリバティブ取引等、資金調達プログラム及び与信・流動性ファシリティに係る 資金流出額	3,239,181	1,748,561	3,112,950	1,650,363
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	1,442,179	1,442,179	1,369,317	1,369,317
12	うち、資金調達プログラムに係る資金流出額	-	-	-	-
13	うち、与信・流動性ファシリティに係る資金流出額	1,797,002	306,381	1,743,633	281,046
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	3,578,147	655,508	3,027,148	448,932
15	偶発事象に係る資金流出額	3,618,644	103,000	3,509,532	106,481
16	資金流出合計額		10,494,009		10,627,107
資金流入額 (3)					
		資金流入率を 乗じる前の額	資金流入率を 乗じた後の額	資金流入率を 乗じる前の額	資金流入率を 乗じた後の額
17	有担保資金運用等に係る資金流入額	153,495	-	-	-
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	3,601,253	2,668,059	2,534,739	1,853,631
19	その他資金流入額	4,209,917	327,064	3,545,163	200,072
20	資金流入合計額	7,964,665	2,995,123	6,079,902	2,053,703
単体流動性カバレッジ比率 (4)					
21	算入可能適格流動資産の合計額		27,244,933		27,807,462
22	純資金流出額		7,498,886		8,573,404
23	単体流動性カバレッジ比率		363.3%		324.3%
24	平均値計算用データ数		60		63