

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 (2021/10-12)		前四半期 (2021/7-9)	
適格流動資産 (1)					
1	適格流動資産の合計額	26,973,529		29,766,478	
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	40,578	4,025	39,931	3,960
3	うち、安定預金の額	464	13	461	13
4	うち、準安定預金の額	40,114	4,011	39,470	3,947
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	11,199,482	7,981,706	11,043,221	7,859,832
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	10,380,920	7,163,145	10,216,895	7,033,505
8	うち、負債性有価証券の額	818,561	818,561	826,326	826,326
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		215,945		329,042
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	3,079,394	1,797,227	2,980,114	1,695,313
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	1,541,747	1,541,747	1,434,880	1,434,880
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	1,537,646	255,479	1,545,233	260,432
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	2,745,242	542,347	2,918,236	491,907
15	偶発事象に係る資金流出額	3,887,145	101,259	4,228,890	113,709
16	資金流出合計額		10,642,512		10,493,765
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	1,204,003	-	780,283	-
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	6,439,201	5,560,405	5,178,001	4,304,983
19	その他資金流入額	3,012,721	232,034	4,037,862	233,944
20	資金流入合計額	10,655,925	5,792,439	9,996,147	4,538,927
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		26,973,529		29,766,478
22	純資金流出額		4,856,713		5,954,837
23	単体流動性カバレッジ比率		555.3%		499.8%
24	平均値計算用データ数		63		61