

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 (29/10-12)		前四半期 (29/7-9)	
適格流動資産 (1)					
1	適格流動資産の合計額	36,412,857		37,230,666	
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	59,264	5,941	59,664	5,987
3	うち、安定預金の額	359	11	333	10
4	うち、準安定預金の額	58,904	5,930	59,331	5,977
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	11,017,072	8,112,622	10,589,566	7,925,393
6	うち、適格オペレーショナル預金の額	0	0	0	0
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	9,892,304	6,987,854	9,410,124	6,745,950
8	うち、負債性有価証券の額	1,124,769	1,124,769	1,179,442	1,179,442
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		259,727		324,671
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	2,733,287	1,693,107	2,705,770	1,668,668
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	1,445,176	1,445,176	1,418,185	1,418,185
12	うち、資金調達プログラムに係る資金流出額	0	0	0	0
13	うち、与信・流動性ファシリティに係る資金流出額	1,288,111	247,931	1,287,585	250,483
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	4,511,643	235,331	3,951,289	202,548
15	偶発事象に係る資金流出額	3,270,516	142,613	3,231,039	130,578
16	資金流出合計額		10,449,341		10,257,845
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	1,139,727	0	1,256,461	0
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	4,498,245	3,980,188	3,271,300	2,765,442
19	その他資金流入額	5,890,625	483,049	6,472,382	964,172
20	資金流入合計額	11,528,597	4,463,237	11,000,143	3,729,614
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		36,412,857		37,230,666
22	純資金流出額		5,986,104		6,528,231
23	単体流動性カバレッジ比率		608.2%		570.3%
24	平均値計算用データ数		62		62