

連結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 (30/10-12)		前四半期 (30/7-9)	
適格流動資産 (1)					
1	適格流動資産の合計額	30,028,554		33,838,080	
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	47,027	4,677	50,794	5,053
3	うち、安定預金の額	372	11	384	12
4	うち、準安定預金の額	46,655	4,665	50,410	5,041
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	10,573,627	7,627,886	11,649,636	8,815,636
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	9,765,777	6,820,036	10,277,870	7,443,869
8	うち、負債性有価証券の額	807,850	807,850	1,371,766	1,371,766
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		171,326		218,809
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	2,567,208	1,550,987	2,579,119	1,612,563
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	1,313,370	1,313,370	1,373,206	1,373,206
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	1,253,838	237,617	1,205,913	239,358
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	5,306,955	445,495	5,307,288	387,308
15	偶発事象に係る資金流出額	5,272,121	259,956	5,148,533	246,557
16	資金流出合計額		10,060,327		11,285,925
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	494,842	0	806,366	0
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	2,882,498	2,394,926	3,713,099	3,208,271
19	その他資金流入額	5,356,903	353,406	5,922,651	437,760
20	資金流入合計額	8,734,243	2,748,331	10,442,116	3,646,031
連結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		30,028,554		33,838,080
22	純資金流出額		7,311,995		7,639,894
23	連結流動性カバレッジ比率		410.6%		442.9%
24	平均値計算用データ数		62		62