

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 (2020/7-9)		前四半期 (2020/4-6)	
適格流動資産 (1)					
1	適格流動資産の合計額	28,855,718		28,002,569	
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	41,380	4,107	41,693	4,143
3	うち、安定預金の額	432	12	369	11
4	うち、準安定預金の額	40,947	4,094	41,323	4,132
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	11,015,965	7,961,814	12,347,960	8,309,881
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	10,374,791	7,320,640	11,671,071	7,632,992
8	うち、負債性有価証券の額	641,174	641,174	676,888	676,888
9	有担保資金調達等に係る資金流出額	340,834		353,070	
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	3,111,741	1,671,409	2,951,509	1,675,769
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	1,390,344	1,390,344	1,413,059	1,413,059
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	1,721,397	281,065	1,538,450	262,710
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	3,788,479	457,023	3,752,940	265,198
15	偶発事象に係る資金流出額	5,132,705	133,103	4,979,382	136,138
16	資金流出合計額	10,568,292		10,744,202	
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	190,529	0	159,415	0
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	2,647,144	1,847,297	2,394,865	1,605,734
19	その他資金流入額	4,149,854	408,425	4,317,152	514,671
20	資金流入合計額	6,987,528	2,255,723	6,871,434	2,120,405
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	28,855,718		28,002,569	
22	純資金流出額	8,312,569		8,623,796	
23	連結流動性カバレッジ比率	347.1%		324.7%	
24	平均値計算用データ数	61		61	