

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 (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	27,164,191		29,992,318	
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	11,240,433	8,022,460	11,084,357	7,900,967
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	10,422,224	7,204,251	10,258,120	7,074,731
8	うち、負債性有価証券の額	818,208	818,208	826,236	826,236
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	3,204,169	1,824,868	3,085,714	1,720,118
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	1,662,422	283,121	1,650,833	285,237
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	2,755,408	552,513	2,916,871	490,541
15	偶発事象に係る資金流出額	5,818,101	127,319	5,775,344	132,811
16	資金流出合計額	10,747,133		10,577,442	
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	6,345,710	5,466,564	5,100,778	4,226,859
19	その他資金流入額	3,009,620	234,303	3,871,768	195,564
20	資金流入合計額	10,559,334	5,700,867	9,752,830	4,422,423
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	27,164,191		29,992,318	
22	純資金流出額	5,046,265		6,155,019	
23	連結流動性カバレッジ比率	538.3%		487.2%	
24	平均値計算用データ数	63		61	