

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 (2023/10-12)		前四半期 (2023/7-9)	
適格流動資産 (1)					
1	適格流動資産の合計額	26,795,226		28,540,348	
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	10,371	1,008	11,258	1,094
3	うち、安定預金の額	411	12	442	13
4	うち、準安定預金の額	9,960	996	10,815	1,081
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	15,201,432	12,147,454	15,677,081	12,463,756
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	14,447,340	11,393,362	14,572,000	11,358,675
8	うち、負債性有価証券の額	754,092	754,092	1,105,080	1,105,080
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		119,170		248,500
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	4,750,815	2,938,017	4,861,246	3,032,411
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	2,593,726	2,593,726	2,686,275	2,686,275
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	2,157,088	344,291	2,174,971	346,136
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	3,450,394	197,898	3,369,921	174,714
15	偶発事象に係る資金流出額	7,438,120	162,582	7,343,840	165,613
16	資金流出合計額		15,566,131		16,086,091
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	213,183	-	98,873	6,431
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	1,894,607	1,320,787	1,991,016	1,372,111
19	その他資金流入額	3,662,128	331,507	4,239,437	396,258
20	資金流入合計額	5,769,919	1,652,295	6,329,327	1,774,801
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		26,795,226		28,540,348
22	純資金流出額		13,913,836		14,311,290
23	連結流動性カバレッジ比率		192.5%		199.4%
24	平均値計算用データ数		62		62