

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 (2021/7-9)		前四半期 (2021/4-6)	
適格流動資産 (1)					
1	適格流動資産の合計額	29,766,478		28,901,271	
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	39,931	3,960	40,162	3,982
3	うち、安定預金の額	461	13	488	14
4	うち、準安定預金の額	39,470	3,947	39,674	3,967
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	11,043,221	7,859,832	12,510,406	8,302,502
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	10,216,895	7,033,505	11,705,445	7,497,541
8	うち、負債性有価証券の額	826,326	826,326	804,960	804,960
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		329,042		367,828
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	2,980,114	1,695,313	3,170,085	1,772,305
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	1,434,880	1,434,880	1,470,900	1,470,900
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	1,545,233	260,432	1,699,185	301,404
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	2,918,236	491,907	3,454,317	522,034
15	偶発事象に係る資金流出額	4,228,890	113,709	3,839,902	108,987
16	資金流出合計額		10,493,765		11,077,640
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	780,283	-	390,225	-
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	5,178,001	4,304,983	4,298,837	3,493,577
19	その他資金流入額	4,037,862	233,944	3,941,354	238,989
20	資金流入合計額	9,996,147	4,538,927	8,630,416	3,732,566
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		29,766,478		28,901,271
22	純資金流出額		5,954,837		7,345,073
23	単体流動性カバレッジ比率		499.8%		393.4%
24	平均値計算用データ数		61		61