

## 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 (2020/10-12)		前四半期 (2020/7-9)	
<b>適格流動資産 (1)</b>					
1	適格流動資産の合計額	28,097,281		28,855,718	
<b>資金流出額 (2)</b>		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	41,736	4,137	41,380	4,107
3	うち、安定預金の額	513	15	432	12
4	うち、準安定預金の額	41,223	4,122	40,947	4,094
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	11,257,812	8,225,272	11,015,965	7,961,814
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	10,602,686	7,570,146	10,374,791	7,320,640
8	うち、負債性有価証券の額	655,125	655,125	641,174	641,174
9	有担保資金調達等に係る資金流出額	223,197		340,834	
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	3,143,910	1,655,465	3,111,741	1,671,409
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	1,369,317	1,369,317	1,390,344	1,390,344
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	1,774,593	286,148	1,721,397	281,065
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	3,025,956	447,740	3,788,479	457,023
15	偶発事象に係る資金流出額	5,279,548	129,312	5,132,705	133,103
16	資金流出合計額	10,685,126		10,568,292	
<b>資金流入額 (3)</b>		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	-
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	2,473,163	1,791,776	2,647,144	1,847,297
19	その他資金流入額	3,540,081	200,675	4,149,854	408,425
20	資金流入合計額	6,013,244	1,992,451	6,987,528	2,255,723
<b>連結流動性カバレッジ比率 (4)</b>					
21	算入可能適格流動資産の合計額	28,097,281		28,855,718	
22	純資金流出額	8,692,675		8,312,569	
23	連結流動性カバレッジ比率	323.2%		347.1%	
24	平均値計算用データ数	63		61	