

## 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 (30/7-9)		前四半期 (30/4-6)	
<b>適格流動資産 (1)</b>					
1	適格流動資産の合計額	33,838,080		36,255,368	
<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	50,794	5,053	59,959	5,970
3	うち、安定預金の額	384	12	374	11
4	うち、準安定預金の額	50,410	5,041	59,584	5,959
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	11,649,636	8,815,636	12,790,115	9,160,694
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	10,277,870	7,443,869	11,605,657	7,976,236
8	うち、負債性有価証券の額	1,371,766	1,371,766	1,184,458	1,184,458
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		218,809		194,812
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	2,579,119	1,612,563	2,622,660	1,598,584
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	1,373,206	1,373,206	1,349,770	1,349,770
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	1,205,913	239,358	1,272,890	248,814
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	5,307,288	387,308	4,562,934	302,330
15	偶発事象に係る資金流出額	5,148,533	246,557	4,740,151	207,263
16	資金流出合計額		11,285,925		11,469,654
<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	806,366	0	708,138	0
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	3,713,099	3,208,271	3,538,956	3,031,396
19	その他資金流入額	5,922,651	437,760	5,428,369	388,139
20	資金流入合計額	10,442,116	3,646,031	9,675,463	3,419,536
<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		33,838,080		36,255,368
22	純資金流出額		7,639,894		8,050,118
23	連結流動性カバレッジ比率		442.9%		450.3%
24	平均値計算用データ数		62		62