

## 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 (30/10-12)		前四半期 (30/7-9)	
<b>適格流動資産 (1)</b>					
1	適格流動資産の合計額	30,028,554		33,838,080	
<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	47,027	4,677	50,794	5,053
3	うち、安定預金の額	372	11	384	12
4	うち、準安定預金の額	46,655	4,665	50,410	5,041
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	10,573,627	7,627,886	11,649,636	8,815,636
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	9,765,777	6,820,036	10,277,870	7,443,869
8	うち、負債性有価証券の額	807,850	807,850	1,371,766	1,371,766
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		171,326		218,809
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	2,567,208	1,550,987	2,579,119	1,612,563
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	1,313,370	1,313,370	1,373,206	1,373,206
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	1,253,838	237,617	1,205,913	239,358
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	5,306,955	445,495	5,307,288	387,308
15	偶発事象に係る資金流出額	5,272,121	259,956	5,148,533	246,557
16	資金流出合計額		10,060,327		11,285,925
<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	494,842	0	806,366	0
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	2,882,498	2,394,926	3,713,099	3,208,271
19	その他資金流入額	5,356,903	353,406	5,922,651	437,760
20	資金流入合計額	8,734,243	2,748,331	10,442,116	3,646,031
<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		30,028,554		33,838,080
22	純資金流出額		7,311,995		7,639,894
23	連結流動性カバレッジ比率		410.6%		442.9%
24	平均値計算用データ数		62		62