

## 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 (2019/10-12)		前四半期 (2019/7-9)	
<b>適格流動資産 (1)</b>					
1	適格流動資産の合計額	26,893,875		27,620,064	
<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	44,647	4,438	45,265	4,499
3	うち、安定預金の額	375	11	394	12
4	うち、準安定預金の額	44,272	4,427	44,872	4,487
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	10,249,629	7,298,204	10,667,813	7,806,074
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	9,534,329	6,582,904	10,066,119	7,204,380
8	うち、負債性有価証券の額	715,299	715,299	601,694	601,694
9	有担保資金調達等に係る資金流出額	134,665		179,965	
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	2,819,119	1,635,130	2,682,824	1,593,420
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	1,358,068	1,358,068	1,319,464	1,319,464
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	1,461,051	277,062	1,363,359	273,956
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	5,139,839	583,392	5,381,036	532,681
15	偶発事象に係る資金流出額	5,160,220	196,132	5,324,173	205,997
16	資金流出合計額	9,851,962		10,322,636	
<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	198,195	0	10,484	0
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	2,927,099	2,215,085	3,949,853	3,007,057
19	その他資金流入額	5,254,560	613,796	5,422,244	445,521
20	資金流入合計額	8,379,854	2,828,881	9,382,580	3,452,578
<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	26,893,875		27,620,064	
22	純資金流出額	7,023,081		6,870,058	
23	連結流動性カバレッジ比率	382.9%		402.0%	
24	平均値計算用データ数	62		62	