

## 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 (2021/4-6)		前四半期 (2021/1-3)	
<b>適格流動資産 (1)</b>					
1	適格流動資産の合計額	29,090,495		27,477,326	
<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	40,162	3,982	41,533	4,118
3	うち、安定預金の額	488	14	500	15
4	うち、準安定預金の額	39,674	3,967	41,033	4,103
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	12,520,644	8,312,740	10,657,144	7,638,363
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	11,715,761	7,507,857	9,906,827	6,888,046
8	うち、負債性有価証券の額	804,882	804,882	750,317	750,317
9	有担保資金調達等に係る資金流出額	367,828		344,212	
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	3,170,604	1,759,464	3,212,017	1,728,688
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	1,470,900	1,470,900	1,442,179	1,442,179
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	1,699,704	288,564	1,769,838	286,509
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	3,452,489	520,206	3,578,558	655,919
15	偶発事象に係る資金流出額	5,591,997	130,860	5,468,388	129,214
16	資金流出合計額	11,095,082		10,500,517	
<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	390,225	-	153,495	-
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	4,172,914	3,367,208	3,541,900	2,607,994
19	その他資金流入額	3,939,659	240,438	4,204,446	327,812
20	資金流入合計額	8,502,799	3,607,646	7,899,842	2,935,806
<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	29,090,495		27,477,326	
22	純資金流出額	7,487,435		7,564,711	
23	連結流動性カバレッジ比率	388.5%		363.2%	
24	平均値計算用データ数	61		60	