

## 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 (2021/7-9)		前四半期 (2021/4-6)	
<b>適格流動資産(1)</b>					
1	適格流動資産の合計額	29,992,318		29,090,495	
<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	39,931	3,960	40,162	3,982
3	うち、安定預金の額	461	13	488	14
4	うち、準安定預金の額	39,470	3,947	39,674	3,967
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	11,084,357	7,900,967	12,520,644	8,312,740
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	10,258,120	7,074,731	11,715,761	7,507,857
8	うち、負債性有価証券の額	826,236	826,236	804,882	804,882
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		329,042		367,828
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	3,085,714	1,720,118	3,170,604	1,759,464
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	1,434,880	1,434,880	1,470,900	1,470,900
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	1,650,833	285,237	1,699,704	288,564
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	2,916,871	490,541	3,452,489	520,206
15	偶発事象に係る資金流出額	5,775,344	132,811	5,591,997	130,860
16	資金流出合計額		10,577,442		11,095,082
<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	780,283	-	390,225	-
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	5,100,778	4,226,859	4,172,914	3,367,208
19	その他資金流入額	3,871,768	195,564	3,939,659	240,438
20	資金流入合計額	9,752,830	4,422,423	8,502,799	3,607,646
<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		29,992,318		29,090,495
22	純資金流出額		6,155,019		7,487,435
23	連結流動性カバレッジ比率		487.2%		388.5%
24	平均値計算用データ数		61		61