

## 単体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<br>(2021/4-6) |                  | 前四半期<br>(2021/1-3) |                  |
|-------------------------|---|--------------------|------------------|--------------------|------------------|
| <b>適格流動資産 (1)</b>       |   |                    |                  |                    |                  |
| 1                       | 適格流動資産の合計額  | 28,901,271         |                  | 27,244,933         |                  |
| <b>資金流出額 (2)</b>        |   |                    |                  |                    |                  |
|                         |   | 資金流出率を<br>乗じる前の額   | 資金流出率を<br>乗じた後の額 | 資金流出率を<br>乗じる前の額   | 資金流出率を<br>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                               | 12,510,406         | 8,302,502        | 10,657,390         | 7,638,609        |
| 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<br>セール無担保資金調達に係る資金の額 | 11,705,445         | 7,497,541        | 9,906,985          | 6,888,204        |
| 8                       | うち、負債性有価証券の額  | 804,960            | 804,960          | 750,404            | 750,404          |
| 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<br>資金流出額       | 3,170,085          | 1,772,305        | 3,239,181          | 1,748,561        |
| 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                             | 1,699,185          | 301,404          | 1,797,002          | 306,381          |
| 14                      | 資金提供義務に基づく資金流出額等                                    | 3,454,317          | 522,034          | 3,578,147          | 655,508          |
| 15                      | 偶発事象に係る資金流出額  | 3,839,902          | 108,987          | 3,618,644          | 103,000          |
| 16                      | 資金流出合計額   |                    | 11,077,640       |                    | 10,494,009       |
| <b>資金流入額 (3)</b>        |   |                    |                  |                    |                  |
|                         |   | 資金流入率を<br>乗じる前の額   | 資金流入率を<br>乗じた後の額 | 資金流入率を<br>乗じる前の額   | 資金流入率を<br>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                                     | 4,298,837          | 3,493,577        | 3,601,253          | 2,668,059        |
| 19                      | その他資金流入額  | 3,941,354          | 238,989          | 4,209,917          | 327,064          |
| 20                      | 資金流入合計額   | 8,630,416          | 3,732,566        | 7,964,665          | 2,995,123        |
| <b>単体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                                      |                    | 28,901,271       |                    | 27,244,933       |
| 22                      | 純資金流出額  |                    | 7,345,073        |                    | 7,498,886        |
| 23                      | 単体流動性カバレッジ比率  |                    | 393.4%           |                    | 363.3%           |
| 24                      | 平均値計算用データ数  |                    | 61               |                    | 60               |