

## 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 (2021/1-3)		前四半期 (2020/10-12)	
<b>適格流動資産 (1)</b>					
1	適格流動資産の合計額	27,477,326		28,097,281	
<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	41,533	4,118	41,736	4,137
3	うち、安定預金の額	500	15	513	15
4	うち、準安定預金の額	41,033	4,103	41,223	4,122
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	10,657,144	7,638,363	11,257,812	8,225,272
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	9,906,827	6,888,046	10,602,686	7,570,146
8	うち、負債性有価証券の額	750,317	750,317	655,125	655,125
9	有担保資金調達等に係る資金流出額	344,212		223,197	
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	3,212,017	1,728,688	3,143,910	1,655,465
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	1,442,179	1,442,179	1,369,317	1,369,317
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	1,769,838	286,509	1,774,593	286,148
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	3,578,558	655,919	3,025,956	447,740
15	偶発事象に係る資金流出額	5,468,388	129,214	5,279,548	129,312
16	資金流出合計額	10,500,517		10,685,126	
<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	153,495	-	-	-
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	3,541,900	2,607,994	2,473,163	1,791,776
19	その他資金流入額	4,204,446	327,812	3,540,081	200,675
20	資金流入合計額	7,899,842	2,935,806	6,013,244	1,992,451
<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	27,477,326		28,097,281	
22	純資金流出額	7,564,711		8,692,675	
23	連結流動性カバレッジ比率	363.2%		323.2%	
24	平均値計算用データ数	60		63	