

### Ⅲ. 流動性カバレッジ比率に関する定量的開示事項【連結・単体共通】

#### 1. 流動性カバレッジ比率に関する定量的開示事項【連結】

(単位：百万円、%、件)

項目		2020年度第4四半期 (2021年1月1日から2021年3月31日まで)		2020年度第3四半期 (2020年10月1日から2020年12月31日まで)	
		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
適格流動資産 (1)					
1	適格流動資産の合計額	1,744,312		1,776,328	
資金流出額 (2)					
2	リテール無担保資金調達に係る資金流出額	5,507,461	431,280	5,438,256	425,641
3	うち、安定預金の額	1,902,254	57,067	1,882,538	56,476
4	うち、準安定預金の額	3,605,207	374,213	3,555,717	369,165
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,954,346	894,638	1,943,035	864,634
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	1,821,895	762,187	1,808,000	729,600
8	うち、負債性有価証券の額	132,451	132,451	135,034	135,034
9	有担保資金調達等に係る資金流出額	—	4,819	—	14,032
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	1,661,525	201,768	1,675,310	200,375
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	63,337	63,337	59,849	59,849
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	1,598,187	138,431	1,615,460	140,526
14	資金提供義務等に基づく資金流出額等	68,085	57,722	75,901	69,183
15	偶発事象に係る資金流出額	45,110	12,744	42,613	10,665
16	資金流出合計額	—	1,602,975	—	1,584,533
資金流入額 (3)					
17	有担保資金運用等に係る資金流入額	—	—	—	—
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	809,583	639,769	759,267	606,682
19	その他資金流入額	126,526	99,015	116,594	91,918
20	資金流入合計額	936,109	738,784	875,861	698,600
連結流動性カバレッジ比率 (4)					
21	算入可能適格流動資産の合計額	—	1,744,312	—	1,776,328
22	純資金流出額	—	864,190	—	885,932
23	連結流動性カバレッジ比率	—	201.8	—	200.5
24	平均値計算用データ数	60		63	

2. 流動性カバレッジ比率に関する定量的開示事項【単体】

(単位：百万円、%、件)

項目		2020年度第4四半期 (2021年1月1日から2021年3月31日まで)		2020年度第3四半期 (2020年10月1日から2020年12月31日まで)	
<b>適格流動資産 (1)</b>					
1	適格流動資産の合計額	1,744,312		1,776,328	
<b>資金流出額 (2)</b>					
2	リテール無担保資金調達に係る資金流出額	資金流出率を乗じる前の額	資金流出率を乗じた後の額	資金流出率を乗じる前の額	資金流出率を乗じた後の額
3	うち、安定預金の額	5,507,461	431,280	5,438,256	425,641
4	うち、準安定預金の額	1,902,254	57,067	1,882,538	56,476
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	3,605,207	374,213	3,555,717	369,165
6	うち、適格オペレーショナル預金の額	1,965,300	905,592	1,952,700	874,299
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	—	—	—	—
8	うち、負債性有価証券の額	1,831,632	771,924	1,816,886	738,485
9	有担保資金調達等に係る資金流出額	133,667	133,667	135,814	135,814
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	4,819	—	—	14,032
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	1,668,653	204,006	1,681,984	202,509
12	うち、資金調達プログラムに係る資金流出額	63,365	63,365	59,852	59,852
13	うち、与信・流動性ファシリティに係る資金流出額	—	—	—	—
14	資金提供義務等に基づく資金流出額等	1,605,287	140,641	1,622,132	142,657
15	偶発事象に係る資金流出額	40,875	30,512	50,415	43,698
16	偶発事象に係る資金流出額	45,110	12,744	42,613	10,665
16	資金流出合計額	1,588,956	—	1,570,846	—
<b>資金流入額 (3)</b>					
17	有担保資金運用等に係る資金流入額	資金流入率を乗じる前の額	資金流入率を乗じた後の額	資金流入率を乗じる前の額	資金流入率を乗じた後の額
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	—	—	—	—
19	その他資金流入額	809,892	639,923	759,814	607,015
20	資金流入合計額	126,558	99,048	116,601	91,924
20	資金流入合計額	936,451	738,971	876,415	698,940
<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	1,744,312		1,776,328	
22	純資金流出額	849,985		871,906	
23	単体流動性カバレッジ比率	205.2		203.7	
24	平均値計算用データ数	60		63	