

**連結流動性カバレッジ比率に関する定量的開示事項**  
(2020年12月期)

(別紙様式第二号)

(単位：百万円、%、件)

項目		当四半期		前四半期	
<b>適格流動資産 (1)</b>					
1	適格流動資産の合計額	2,050,350		1,874,825	
<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	5,192,868	436,362	5,164,577	433,625
3	うち、安定預金の額	1,191,972	35,759	1,190,626	35,718
4	うち、準安定預金の額	4,000,895	400,603	3,973,950	397,906
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,954,883	797,493	1,784,242	670,611
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	1,912,229	754,840	1,722,477	608,847
8	うち、負債性有価証券の額	42,653	42,653	61,764	61,764
9	有担保資金調達等に係る資金流出額			26,518	
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	120,404	25,362	109,025	22,306
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	12,070	12,070	9,997	9,997
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	108,334	13,292	99,028	12,309
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	34,472	26,212	29,576	24,574
15	偶発事象に係る資金流出額	1,192,847	33,461	1,227,438	34,901
16	資金流出合計額	1,343,460		1,212,538	
<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	-	-	-	-
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	245,511	129,020	281,129	154,799
19	その他資金流入額	50,589	20,915	26,663	12,094
20	資金流入合計額	296,100	149,936	307,792	166,893
<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	2,050,350		1,874,825	
22	純資金流出額	1,193,524		1,045,644	
23	連結流動性カバレッジ比率	171.7%		179.2%	
24	平均値計算用データ数	63		61	