

単体流動性カバレッジ比率に関する定量的開示事項（2019年12月期）

（単位：百万円、%、件）

項目		当四半期		前四半期	
適格流動資産（１）					
1	適格流動資産の合計額	2,218,851		2,329,524	
資金流出額（２）		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	5,068,325	390,350	5,043,287	387,893
3	うち、安定預金の額	1,729,372	51,881	1,728,226	51,846
4	うち、準安定預金の額	3,337,969	338,469	3,314,028	336,046
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	2,333,400	1,524,456	2,455,835	1,644,052
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	2,120,264	1,311,320	2,268,436	1,456,653
8	うち、負債性有価証券の額	213,135	213,135	187,398	187,398
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		9,403		7,837
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	2,017,341	330,347	2,025,630	339,408
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	104,044	104,044	115,847	115,847
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	1,913,297	226,302	1,909,783	223,560
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	14,425	6,240	27,249	13,141
15	偶発事象に係る資金流出額	35,490	709	36,071	721
16	資金流出合計額		2,261,507		2,393,054
資金流入額（３）		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	613,362	363,942	615,656	384,971
19	その他資金流入額	225,210	182,039	266,035	196,572
20	資金流入合計額	838,572	545,982	881,691	581,544
単体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		2,218,851		2,329,524
22	純資金流出額		1,715,525		1,811,510
23	単体流動性カバレッジ比率		129.3		128.5
24	平均値計算用データ数		62		62

(単位：百万円、%)

KM1：主要な指標（銀行単体）						
国際様式の 該当番号 (注)		イ	ロ	ハ	ニ	ホ
		当四半期	前四半期	前々四半期	八の前四半期	二の前四半期
単体流動性カバレッジ比率						
15	算入可能適格流動性資産の合計額	2,218,851	2,329,524	2,254,330	2,136,134	1,845,800
16	純資金流出額	1,715,525	1,811,510	1,675,244	1,531,338	1,148,205
17	単体流動性カバレッジ比率	129.3	128.5	134.5	139.4	160.7

(注)「国際様式の該当番号」とは、パーセル銀行監督委員会により平成29年3月に公表された「開示要件（第3の柱）の統合及び強化 - 第2フェーズ」と題する最終規則文書における開示様式に記載された項目番号です。

連結流動性カバレッジ比率に関する定量的開示事項（2019年12月期）

（単位：百万円、%、件）

項目		当四半期		前四半期	
適格流動資産（１）					
1	適格流動資産の合計額	2,218,851		2,329,524	
資金流出額（２）		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	5,068,321	390,349	5,043,285	387,893
3	うち、安定預金の額	1,729,372	51,881	1,728,226	51,846
4	うち、準安定預金の額	3,337,965	338,468	3,314,026	336,046
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	2,319,885	1,510,942	2,444,082	1,632,298
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	2,108,120	1,299,177	2,258,215	1,446,432
8	うち、負債性有価証券の額	211,765	211,765	185,866	185,866
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		9,403		7,837
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	1,980,289	315,526	1,989,282	324,868
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	104,044	104,044	115,847	115,847
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	1,876,245	211,482	1,873,435	209,021
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	42,926	34,741	53,768	39,660
15	偶発事象に係る資金流出額	35,490	709	36,071	721
16	資金流出合計額		2,261,673		2,393,280
資金流入額（３）		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	599,862	350,523	598,968	368,413
19	その他資金流入額	225,197	182,027	266,024	196,561
20	資金流入合計額	825,060	532,551	864,992	564,974
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		2,218,851		2,329,524
22	純資金流出額		1,729,122		1,828,306
23	連結流動性カバレッジ比率		128.3		127.4
24	平均値計算用データ数		62		62

(単位：百万円、%)

KM1：主要な指標（銀行連結・持株）						
国際様式の 該当番号 (注)		イ	ロ	ハ	ニ	ホ
		当四半期	前四半期	前々四半期	八の前四半期	二の前四半期
連結流動性カバレッジ比率						
15	算入可能適格流動性資産の合計額	2,218,851	2,329,524	2,254,330	2,136,134	1,845,800
16	純資金流出額	1,729,122	1,828,306	1,698,032	1,545,266	1,163,641
17	連結流動性カバレッジ比率	128.3	127.4	132.7	138.2	158.6

(注)「国際様式の該当番号」とは、パーセル銀行監督委員会により平成29年3月に公表された「開示要件（第3の柱）の統合及び強化 - 第2フェーズ」と題する最終規則文書における開示様式に記載された項目番号です。