

単体流動性カバレッジ比率に関する定量的開示事項（2020年3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	2,295,719		2,218,851	
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	5,146,646	395,035	5,068,325	390,350
3	うち、安定預金の額	1,774,455	53,233	1,729,372	51,881
4	うち、準安定預金の額	3,371,196	341,801	3,337,969	338,469
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	2,440,255	1,608,244	2,333,400	1,524,456
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	2,245,099	1,413,088	2,120,264	1,311,320
8	うち、負債性有価証券の額	195,156	195,156	213,135	213,135
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		13,352		9,403
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	2,005,534	330,326	2,017,341	330,347
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	107,354	107,354	104,044	104,044
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	1,898,179	222,971	1,913,297	226,302
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	22,618	13,809	14,425	6,240
15	偶発事象に係る資金流出額	33,645	672	35,490	709
16	資金流出合計額		2,361,441		2,261,507
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	638,286	390,737	613,362	363,942
19	その他資金流入額	216,338	176,067	225,210	182,039
20	資金流入合計額	854,624	566,804	838,572	545,982
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		2,295,719		2,218,851
22	純資金流出額		1,794,636		1,715,525
23	単体流動性カバレッジ比率		127.9		129.3
24	平均値計算用データ数		58		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	2,295,719	2,218,851	2,329,524	2,254,330	2,136,134
16	純資金流出額	1,794,636	1,715,525	1,811,510	1,675,244	1,531,338
17	単体流動性カバレッジ比率	127.9	129.3	128.5	134.5	139.4

(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（2020年3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	2,295,719		2,218,851	
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	5,146,642	395,034	5,068,321	390,349
3	うち、安定預金の額	1,774,455	53,233	1,729,372	51,881
4	うち、準安定預金の額	3,371,192	341,801	3,337,965	338,468
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	2,427,410	1,595,399	2,319,885	1,510,942
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	2,234,029	1,402,018	2,108,120	1,299,177
8	うち、負債性有価証券の額	193,380	193,380	211,765	211,765
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		13,352		9,403
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	1,967,814	315,238	1,980,289	315,526
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	107,354	107,354	104,044	104,044
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	1,860,459	207,883	1,876,245	211,482
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	54,419	45,611	42,926	34,741
15	偶発事象に係る資金流出額	33,645	672	35,490	709
16	資金流出合計額		2,365,308		2,261,673
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	623,843	376,384	599,862	350,523
19	その他資金流入額	216,728	176,458	225,197	182,027
20	資金流入合計額	840,572	552,842	825,060	532,551
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		2,295,719		2,218,851
22	純資金流出額		1,812,466		1,729,122
23	連結流動性カバレッジ比率		126.6		128.3
24	平均値計算用データ数		58		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	2,295,719	2,218,851	2,329,524	2,254,330	2,136,134
16	純資金流出額	1,812,466	1,729,122	1,828,306	1,698,032	1,545,266
17	連結流動性カバレッジ比率	126.6	128.3	127.4	132.7	138.2

(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。