

## 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6月期）

（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	2,336,381		2,295,719	
<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	5,186,646	398,356	5,146,646	395,035
3	うち、安定預金の額	1,783,691	53,510	1,774,455	53,233
4	うち、準安定預金の額	3,402,113	344,845	3,371,196	341,801
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	2,741,221	1,730,011	2,440,255	1,608,244
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	2,650,584	1,639,374	2,245,099	1,413,088
8	うち、負債性有価証券の額	90,636	90,636	195,156	195,156
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		14,255		13,352
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	2,000,311	342,263	2,005,534	330,326
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	125,082	125,082	107,354	107,354
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	1,875,229	217,181	1,898,179	222,971
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	20,145	12,194	22,618	13,809
15	偶発事象に係る資金流出額	33,217	664	33,645	672
16	資金流出合計額		2,497,744		2,361,441
<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	597,239	361,282	638,286	390,737
19	その他資金流入額	264,818	193,821	216,338	176,067
20	資金流入合計額	862,058	555,104	854,624	566,804
<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		2,336,381		2,295,719
22	純資金流出額		1,942,640		1,794,636
23	単体流動性カバレッジ比率		120.2		127.9
24	平均値計算用データ数		61		58

(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	2,336,381	2,295,719	2,218,851	2,329,524	2,254,330
16	純資金流出額	1,942,640	1,794,636	1,715,525	1,811,510	1,675,244
17	単体流動性カバレッジ比率	120.2	127.9	129.3	128.5	134.5

（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6月期）

（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	2,336,381		2,295,719	
<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	5,186,642	398,356	5,146,642	395,034
3	うち、安定預金の額	1,783,691	53,510	1,774,455	53,233
4	うち、準安定預金の額	3,402,108	344,845	3,371,192	341,801
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	2,727,986	1,716,776	2,427,410	1,595,399
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	2,638,203	1,626,992	2,234,029	1,402,018
8	うち、負債性有価証券の額	89,783	89,783	193,380	193,380
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		14,255		13,352
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	1,962,317	327,066	1,967,814	315,238
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	125,082	125,082	107,354	107,354
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	1,837,235	201,983	1,860,459	207,883
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	52,469	44,517	54,419	45,611
15	偶発事象に係る資金流出額	33,217	664	33,645	672
16	資金流出合計額		2,501,635		2,365,308
<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	584,385	348,502	623,843	376,384
19	その他資金流入額	264,805	193,808	216,728	176,458
20	資金流入合計額	849,191	542,310	840,572	552,842
<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		2,336,381		2,295,719
22	純資金流出額		1,959,324		1,812,466
23	連結流動性カバレッジ比率		119.2		126.6
24	平均値計算用データ数		61		58

(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	2,336,381	2,295,719	2,218,851	2,329,524	2,254,330
16	純資金流出額	1,959,324	1,812,466	1,729,122	1,828,306	1,698,032
17	連結流動性カバレッジ比率	119.2	126.6	128.3	127.4	132.7

（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。