

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9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	2,342,185		2,336,381	
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	5,395,464	411,218	5,186,646	398,356
3	うち、安定預金の額	1,899,685	56,990	1,783,691	53,510
4	うち、準安定預金の額	3,494,911	354,227	3,402,113	344,845
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	2,497,130	1,530,355	2,741,221	1,730,011
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	2,435,884	1,469,109	2,650,584	1,639,374
8	うち、負債性有価証券の額	61,246	61,246	90,636	90,636
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		32,580		14,255
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	2,056,315	334,469	2,000,311	342,263
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	105,013	105,013	125,082	125,082
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	1,951,302	229,456	1,875,229	217,181
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	8,820	6,446	20,145	12,194
15	偶発事象に係る資金流出額	32,677	653	33,217	664
16	資金流出合計額		2,315,723		2,497,744
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	575,314	350,340	597,239	361,282
19	その他資金流入額	213,495	148,340	264,818	193,821
20	資金流入合計額	788,809	498,681	862,058	555,104
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		2,342,185		2,336,381
22	純資金流出額		1,817,042		1,942,640
23	単体流動性カバレッジ比率		128.9		120.2
24	平均値計算用データ数		61		61

(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	2,342,185	2,336,381	2,295,719	2,218,851	2,329,524
16	純資金流出額	1,817,042	1,942,640	1,794,636	1,715,525	1,811,510
17	単体流動性カバレッジ比率	128.9	120.2	127.9	129.3	128.5

（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9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	2,342,185		2,336,381	
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	5,395,460	411,218	5,186,642	398,356
3	うち、安定預金の額	1,899,685	56,990	1,783,691	53,510
4	うち、準安定預金の額	3,494,908	354,227	3,402,108	344,845
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	2,482,679	1,515,904	2,727,986	1,716,776
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	2,423,061	1,456,286	2,638,203	1,626,992
8	うち、負債性有価証券の額	59,618	59,618	89,783	89,783
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		32,580		14,255
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	2,017,247	318,841	1,962,317	327,066
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	105,013	105,013	125,082	125,082
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	1,912,233	213,828	1,837,235	201,983
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	39,479	37,104	52,469	44,517
15	偶発事象に係る資金流出額	32,677	653	33,217	664
16	資金流出合計額		2,316,303		2,501,635
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	555,629	330,815	584,385	348,502
19	その他資金流入額	213,480	148,325	264,805	193,808
20	資金流入合計額	769,109	479,140	849,191	542,310
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		2,342,185		2,336,381
22	純資金流出額		1,837,162		1,959,324
23	連結流動性カバレッジ比率		127.4		119.2
24	平均値計算用データ数		61		61

(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	2,342,185	2,336,381	2,295,719	2,218,851	2,329,524
16	純資金流出額	1,837,162	1,959,324	1,812,466	1,729,122	1,828,306
17	連結流動性カバレッジ比率	127.4	119.2	126.6	128.3	127.4

(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。