

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	2,437,953		2,342,185	
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	5,419,006	414,183	5,395,464	411,218
3	うち、安定預金の額	1,890,455	56,713	1,899,685	56,990
4	うち、準安定預金の額	3,527,732	357,470	3,494,911	354,227
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	2,576,404	1,553,150	2,497,130	1,530,355
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	2,507,279	1,484,024	2,435,884	1,469,109
8	うち、負債性有価証券の額	69,125	69,125	61,246	61,246
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		29,405		32,580
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	2,105,340	347,814	2,056,315	334,469
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	113,804	113,804	105,013	105,013
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	1,991,536	234,010	1,951,302	229,456
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	11,620	7,283	8,820	6,446
15	偶発事象に係る資金流出額	33,997	679	32,677	653
16	資金流出合計額		2,352,517		2,315,723
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	558,293	333,018	575,314	350,340
19	その他資金流入額	224,170	171,414	213,495	148,340
20	資金流入合計額	782,464	504,433	788,809	498,681
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		2,437,953		2,342,185
22	純資金流出額		1,848,084		1,817,042
23	単体流動性カバレッジ比率		131.9		128.9
24	平均値計算用データ数		63		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	2,437,953	2,342,185	2,336,381	2,295,719	2,218,851
16	純資金流出額	1,848,084	1,817,042	1,942,640	1,794,636	1,715,525
17	単体流動性カバレッジ比率	131.9	128.9	120.2	127.9	129.3

（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	2,437,953		2,342,185	
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	5,419,002	414,183	5,395,460	411,218
3	うち、安定預金の額	1,890,455	56,713	1,899,685	56,990
4	うち、準安定預金の額	3,527,729	357,469	3,494,908	354,227
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	2,561,269	1,538,015	2,482,679	1,515,904
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	2,493,731	1,470,477	2,423,061	1,456,286
8	うち、負債性有価証券の額	67,538	67,538	59,618	59,618
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		29,405		32,580
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	2,065,592	331,915	2,017,247	318,841
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	113,804	113,804	105,013	105,013
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	1,951,787	218,111	1,912,233	213,828
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	43,063	38,727	39,479	37,104
15	偶発事象に係る資金流出額	33,997	679	32,677	653
16	資金流出合計額		2,352,927		2,316,303
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	545,099	319,899	555,629	330,815
19	その他資金流入額	224,157	171,401	213,480	148,325
20	資金流入合計額	769,257	491,301	769,109	479,140
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		2,437,953		2,342,185
22	純資金流出額		1,861,625		1,837,162
23	連結流動性カバレッジ比率		130.9		127.4
24	平均値計算用データ数		63		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	2,437,953	2,342,185	2,336,381	2,295,719	2,218,851
16	純資金流出額	1,861,625	1,837,162	1,959,324	1,812,466	1,729,122
17	連結流動性カバレッジ比率	130.9	127.4	119.2	126.6	128.3

(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。