

## 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	2,254,330		2,136,134	
<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	4,980,473	384,756	5,000,246	384,973
3	うち、安定預金の額	1,688,412	50,652	1,713,391	51,401
4	うち、準安定預金の額	3,291,188	334,104	3,285,972	333,572
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	2,358,131	1,493,766	2,144,060	1,361,905
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	2,141,728	1,277,363	1,935,753	1,153,598
8	うち、負債性有価証券の額	216,402	216,402	208,307	208,307
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		8,354		3,547
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	2,069,268	361,486	2,064,005	379,096
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	133,683	133,683	151,614	151,614
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	1,935,585	227,803	1,912,391	227,482
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	23,283	15,310	35,290	20,284
15	偶発事象に係る資金流出額	34,138	682	35,139	702
16	資金流出合計額		2,264,357		2,150,511
<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	611,903	379,054	635,564	396,363
19	その他資金流入額	275,751	210,058	290,355	229,632
20	資金流入合計額	887,655	589,112	925,919	625,996
<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		2,254,330		2,136,134
22	純資金流出額		1,675,244		1,531,338
23	単体流動性カバレッジ比率		134.5		139.4
24	平均値計算用データ数		59		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	2,254,330	2,136,134	1,845,800	1,788,202	1,700,504
16	純資金流出額	1,675,244	1,531,338	1,148,205	1,040,791	895,897
17	単体流動性カバレッジ比率	134.5	139.4	160.7	171.8	189.8

(注)「国際様式の該当番号」とは、パーゼ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	2,254,330		2,136,134	
<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	4,980,470	384,756	5,000,243	384,973
3	うち、安定預金の額	1,688,412	50,652	1,713,391	51,401
4	うち、準安定預金の額	3,291,185	334,104	3,285,970	333,571
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	2,347,439	1,483,074	2,133,897	1,351,742
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	2,131,887	1,267,522	1,926,958	1,144,803
8	うち、負債性有価証券の額	215,551	215,551	206,938	206,938
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		8,354		3,547
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	2,032,519	346,786	2,024,997	363,493
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	133,683	133,683	151,614	151,614
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	1,898,836	213,103	1,873,383	211,879
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	50,604	42,630	63,169	48,163
15	偶発事象に係る資金流出額	34,138	682	35,139	702
16	資金流出合計額		2,266,286		2,152,624
<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	589,223	356,551	623,624	384,565
19	その他資金流入額	277,394	211,701	280,433	222,791
20	資金流入合計額	866,617	568,253	904,057	607,357
<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		2,254,330		2,136,134
22	純資金流出額		1,698,032		1,545,266
23	連結流動性カバレッジ比率		132.7		138.2
24	平均値計算用データ数		59		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	2,254,330	2,136,134	1,845,800	1,788,202	1,700,504
16	純資金流出額	1,698,032	1,545,266	1,163,641	1,059,561	922,537
17	連結流動性カバレッジ比率	132.7	138.2	158.6	168.7	184.3

(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。