

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	2,329,524		2,254,330	
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	5,043,287	387,893	4,980,473	384,756
3	うち、安定預金の額	1,728,226	51,846	1,688,412	50,652
4	うち、準安定預金の額	3,314,028	336,046	3,291,188	334,104
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	2,455,835	1,644,052	2,358,131	1,493,766
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	2,268,436	1,456,653	2,141,728	1,277,363
8	うち、負債性有価証券の額	187,398	187,398	216,402	216,402
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		7,837		8,354
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	2,025,630	339,408	2,069,268	361,486
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	115,847	115,847	133,683	133,683
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	1,909,783	223,560	1,935,585	227,803
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	27,249	13,141	23,283	15,310
15	偶発事象に係る資金流出額	36,071	721	34,138	682
16	資金流出合計額		2,393,054		2,264,357
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	615,656	384,971	611,903	379,054
19	その他資金流入額	266,035	196,572	275,751	210,058
20	資金流入合計額	881,691	581,544	887,655	589,112
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		2,329,524		2,254,330
22	純資金流出額		1,811,510		1,675,244
23	単体流動性カバレッジ比率		128.5		134.5
24	平均値計算用データ数		62		59

(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	2,329,524	2,254,330	2,136,134	1,845,800	1,788,202
16	純資金流出額	1,811,510	1,675,244	1,531,338	1,148,205	1,040,791
17	単体流動性カバレッジ比率	128.5	134.5	139.4	160.7	171.8

（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（2019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	2,329,524		2,254,330	
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	5,043,285	387,893	4,980,470	384,756
3	うち、安定預金の額	1,728,226	51,846	1,688,412	50,652
4	うち、準安定預金の額	3,314,026	336,046	3,291,185	334,104
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	2,444,082	1,632,298	2,347,439	1,483,074
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	2,258,215	1,446,432	2,131,887	1,267,522
8	うち、負債性有価証券の額	185,866	185,866	215,551	215,551
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		7,837		8,354
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	1,989,282	324,868	2,032,519	346,786
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	115,847	115,847	133,683	133,683
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	1,873,435	209,021	1,898,836	213,103
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	53,768	39,660	50,604	42,630
15	偶発事象に係る資金流出額	36,071	721	34,138	682
16	資金流出合計額		2,393,280		2,266,286
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	598,968	368,413	589,223	356,551
19	その他資金流入額	266,024	196,561	277,394	211,701
20	資金流入合計額	864,992	564,974	866,617	568,253
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		2,329,524		2,254,330
22	純資金流出額		1,828,306		1,698,032
23	連結流動性カバレッジ比率		127.4		132.7
24	平均値計算用データ数		62		59

(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	2,329,524	2,254,330	2,136,134	1,845,800	1,788,202
16	純資金流出額	1,828,306	1,698,032	1,545,266	1,163,641	1,059,561
17	連結流動性カバレッジ比率	127.4	132.7	138.2	158.6	168.7

（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。