

単体流動性カバレッジ比率に関する定量的開示事項（2021年3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	2,837,508		2,437,953	
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	5,484,299	418,131	5,419,006	414,183
3	うち、安定預金の額	1,931,655	57,949	1,890,455	56,713
4	うち、準安定預金の額	3,551,880	360,182	3,527,732	357,470
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	2,834,506	1,792,688	2,576,404	1,553,150
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	2,759,124	1,717,306	2,507,279	1,484,024
8	うち、負債性有価証券の額	75,382	75,382	69,125	69,125
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		34,602		29,405
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	2,133,000	371,907	2,105,340	347,814
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	138,102	138,102	113,804	113,804
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	1,994,898	233,805	1,991,536	234,010
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	15,949	9,419	11,620	7,283
15	偶発事象に係る資金流出額	34,663	693	33,997	679
16	資金流出合計額		2,627,443		2,352,517
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	589,143	354,516	558,293	333,018
19	その他資金流入額	280,381	236,946	224,170	171,414
20	資金流入合計額	869,524	591,462	782,464	504,433
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		2,837,508		2,437,953
22	純資金流出額		2,035,980		1,848,084
23	単体流動性カバレッジ比率		139.3		131.9
24	平均値計算用データ数		60		63

(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	2,837,508	2,437,953	2,342,185	2,336,381	2,295,719
16	純資金流出額	2,035,980	1,848,084	1,817,042	1,942,640	1,794,636
17	単体流動性カバレッジ比率	139.3	131.9	128.9	120.2	127.9

(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（2021年3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	2,837,508		2,437,953	
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	5,484,296	418,131	5,419,002	414,183
3	うち、安定預金の額	1,931,655	57,949	1,890,455	56,713
4	うち、準安定預金の額	3,551,876	360,181	3,527,729	357,469
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	2,818,741	1,776,923	2,561,269	1,538,015
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	2,744,894	1,703,076	2,493,731	1,470,477
8	うち、負債性有価証券の額	73,847	73,847	67,538	67,538
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		34,602		29,405
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	2,092,438	355,682	2,065,592	331,915
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	138,102	138,102	113,804	113,804
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	1,954,336	217,580	1,951,787	218,111
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	50,883	44,352	43,063	38,727
15	偶発事象に係る資金流出額	34,663	693	33,997	679
16	資金流出合計額		2,630,387		2,352,927
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	573,307	338,764	545,099	319,899
19	その他資金流入額	280,367	236,932	224,157	171,401
20	資金流入合計額	853,675	575,696	769,257	491,301
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		2,837,508		2,437,953
22	純資金流出額		2,054,690		1,861,625
23	連結流動性カバレッジ比率		138.0		130.9
24	平均値計算用データ数		60		63

(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	2,837,508	2,437,953	2,342,185	2,336,381	2,295,719
16	純資金流出額	2,054,690	1,861,625	1,837,162	1,959,324	1,812,466
17	連結流動性カバレッジ比率	138.0	130.9	127.4	119.2	126.6

（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。