

2023年2月3日  
株式会社山口フィナンシャルグループ（連結）

連結流動性カバレッジ比率に関する事項

（平成27年金融庁告示第7号、別紙様式第三号）

（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, 287, 780          |                      | 2, 500, 010          |                      |
| <b>資金流出額 （2）</b>        |                                                 | 資金流出率<br>を乗じる前<br>の額 | 資金流出率<br>を乗じた後<br>の額 | 資金流出率<br>を乗じる前<br>の額 | 資金流出率<br>を乗じた後<br>の額 |
| 2                       | リテール無担保資金調達に係る資金流出額                             | 6, 737, 080          | 545, 526             | 6, 743, 882          | 546, 194             |
| 3                       | うち、安定預金の額                                       | 1, 831, 813          | 54, 954              | 1, 832, 194          | 54, 965              |
| 4                       | うち、準安定預金の額                                      | 4, 905, 266          | 490, 572             | 4, 911, 688          | 491, 228             |
| 5                       | ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額                           | 2, 587, 514          | 1, 116, 244          | 2, 586, 063          | 1, 098, 983          |
| 6                       | うち、適格オペレーショナル預金の額                               | 0                    | 0                    | 0                    | 0                    |
| 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, 367, 426          | 896, 155             | 2, 407, 013          | 919, 932             |
| 8                       | うち、負債性有価証券の額                                    | 220, 088             | 220, 088             | 179, 050             | 179, 050             |
| 9                       | 有担保資金調達等に係る資金流出額                                |                      | 4, 585               |                      | 3, 327               |
| 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       | 600, 542             | 78, 197              | 619, 539             | 75, 302              |
| 11                      | うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額                            | 32, 914              | 32, 914              | 25, 916              | 25, 916              |
| 12                      | うち、資金調達プログラムに係る資金流出額                            | 0                    | 0                    | 0                    | 0                    |
| 13                      | うち、与信・流動性ファシリティに係る資金流出額                         | 567, 627             | 45, 282              | 593, 622             | 49, 385              |
| 14                      | 資金提供義務に基づく資金流出額等                                | 87, 855              | 84, 128              | 81, 364              | 74, 921              |
| 15                      | 偶発事象に係る資金流出額                                    | 380, 667             | 10, 387              | 377, 857             | 10, 425              |
| 16                      | 資金流出合計額                                         |                      | 1, 839, 068          |                      | 1, 809, 155          |
| <b>資金流入額 （3）</b>        |                                                 | 資金流出率<br>を乗じる前<br>の額 | 資金流出率<br>を乗じた後<br>の額 | 資金流出率<br>を乗じる前<br>の額 | 資金流出率<br>を乗じた後<br>の額 |
| 17                      | 有担保資金運用等に係る資金流入額                                | 0                    | 0                    | 0                    | 0                    |
| 18                      | 貸付金等の回収に係る資金流入額                                 | 578, 810             | 415, 864             | 600, 882             | 443, 654             |
| 19                      | その他資金流入額                                        | 45, 060              | 35, 416              | 49, 459              | 45, 358              |
| 20                      | 資金流入合計額                                         | 623, 871             | 451, 280             | 650, 342             | 489, 012             |
| <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, 287, 780          |                      | 2, 500, 010          |
| 22                      | 純資金流出額                                          |                      | 1, 387, 787          |                      | 1, 320, 142          |
| 23                      | 連結流動性カバレッジ比率                                    |                      | 164. 8               |                      | 189. 3               |
| 24                      | 平均値計算用データ数                                      | 62                   |                      | 62                   |                      |