

## 流動性カバレッジ比率に関する定量的開示事項

【ちゅうぎんフィナンシャルグループ連結】2024年12月期（別紙様式第四号）

（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                                      | 1,943,845    |              | 2,036,209    |              |
| 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                             | 5,857,647    | 455,417      | 5,883,772    | 457,134      |
| 3               | うち、安定預金の額                                       | 2,022,639    | 60,679       | 2,036,203    | 61,086       |
| 4               | うち、準安定預金の額                                      | 3,835,007    | 394,738      | 3,847,568    | 396,048      |
| 5               | ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額                           | 2,106,792    | 995,933      | 2,207,575    | 1,024,427    |
| 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 | 2,023,335    | 912,476      | 2,123,581    | 940,433      |
| 8               | うち、負債性有価証券の額                                    | 83,457       | 83,457       | 83,993       | 83,993       |
| 9               | 有担保資金調達等に係る資金流出額                                |              | 32,478       |              | 42,710       |
| 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       | 1,684,284    | 203,733      | 1,693,345    | 203,471      |
| 11              | うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額                            | 59,675       | 59,675       | 59,650       | 59,650       |
| 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                         | 1,624,608    | 144,057      | 1,633,694    | 143,820      |
| 14              | 資金提供義務等に基づく資金流出額等                               | 59,709       | 53,105       | 56,951       | 54,196       |
| 15              | 偶発事象に係る資金流出額                                    | 53,286       | 22,922       | 50,963       | 17,969       |
| 16              | 資金流出合計額                                         |              | 1,763,590    |              | 1,799,909    |
| 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                                 | 474,916      | 289,225      | 469,978      | 285,070      |
| 19              | その他資金流入額                                        | 121,845      | 103,831      | 127,284      | 107,102      |
| 20              | 資金流入合計額                                         | 596,761      | 393,057      | 597,263      | 392,172      |
| 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                                  |              | 1,943,845    |              | 2,036,209    |
| 22              | 純資金流出額                                          |              | 1,370,533    |              | 1,407,736    |
| 23              | 連結流動性カバレッジ比率                                    |              | 141.8        |              | 144.6        |
| 24              | 平均値計算用データ数                                      | 63           |              | 62           |              |

## 流動性カバレッジ比率に関する定量的開示事項

【中国銀行連結】2024年12月期（別紙様式第四号）

（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                                |                                                 | 1,943,845    |              | 2,036,209    |              |
| 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                       |                                                 | 5,857,647    | 455,417      | 5,883,772    | 457,134      |
| 3               |                                           | うち、安定預金の額                                       | 2,022,639    | 60,679       | 2,036,203    | 61,086       |
| 4               |                                           | うち、準安定預金の額                                      | 3,835,007    | 394,738      | 3,847,568    | 396,048      |
| 5               | ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額                     |                                                 | 2,122,497    | 1,011,638    | 2,221,430    | 1,038,282    |
| 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 | 2,038,430    | 927,572      | 2,137,924    | 954,776      |
| 8               |                                           | うち、負債性有価証券の額                                    | 84,066       | 84,066       | 83,506       | 83,506       |
| 9               | 有担保資金調達等に係る資金流出額                          |                                                 |              | 32,478       |              | 42,710       |
| 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 |                                                 | 1,695,960    | 206,434      | 1,704,144    | 206,105      |
| 11              |                                           | うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額                            | 59,712       | 59,712       | 59,710       | 59,710       |
| 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                         | 1,636,247    | 146,721      | 1,644,433    | 146,394      |
| 14              | 資金提供義務等に基づく資金流出額等                         |                                                 | 31,377       | 24,772       | 27,515       | 24,760       |
| 15              | 偶発事象に係る資金流出額                              |                                                 | 53,256       | 22,891       | 50,931       | 17,936       |
| 16              | 資金流出合計額                                   |                                                 |              | 1,753,634    |              | 1,786,929    |
| 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                           |                                                 | 477,277      | 290,405      | 472,802      | 286,482      |
| 19              | その他資金流入額                                  |                                                 | 121,895      | 103,881      | 127,356      | 107,173      |
| 20              | 資金流入合計額                                   |                                                 | 599,173      | 394,287      | 600,158      | 393,655      |
| 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                            |                                                 |              | 1,943,845    |              | 2,036,209    |
| 22              | 純資金流出額                                    |                                                 |              | 1,359,346    |              | 1,393,273    |
| 23              | 連結流動性カバレッジ比率                              |                                                 |              | 142.9        |              | 146.1        |
| 24              | 平均値計算用データ数                                |                                                 | 63           |              | 62           |              |

## 流動性カバレッジ比率に関する定量的開示事項

【中国銀行単体】2024年12月期（別紙様式第三号）

（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                                |                                                 | 1,943,845    |              | 2,036,209    |              |
| 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                       |                                                 | 5,857,647    | 455,417      | 5,883,772    | 457,134      |
| 3               |                                           | うち、安定預金の額                                       | 2,022,639    | 60,679       | 2,036,203    | 61,086       |
| 4               |                                           | うち、準安定預金の額                                      | 3,835,007    | 394,738      | 3,847,568    | 396,048      |
| 5               | ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額                     |                                                 | 2,125,027    | 1,014,169    | 2,224,490    | 1,041,342    |
| 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 | 2,040,651    | 929,792      | 2,140,343    | 957,195      |
| 8               |                                           | うち、負債性有価証券の額                                    | 84,376       | 84,376       | 84,147       | 84,147       |
| 9               | 有担保資金調達等に係る資金流出額                          |                                                 |              | 32,478       |              | 42,710       |
| 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 |                                                 | 1,695,960    | 206,434      | 1,704,144    | 206,105      |
| 11              |                                           | うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額                            | 59,712       | 59,712       | 59,710       | 59,710       |
| 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                         | 1,636,247    | 146,721      | 1,644,433    | 146,394      |
| 14              | 資金提供義務等に基づく資金流出額等                         |                                                 | 24,936       | 18,331       | 20,536       | 17,781       |
| 15              | 偶発事象に係る資金流出額                              |                                                 | 53,256       | 22,891       | 50,931       | 17,936       |
| 16              | 資金流出合計額                                   |                                                 |              | 1,749,723    |              | 1,783,011    |
| 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                           |                                                 | 477,277      | 290,405      | 472,802      | 286,482      |
| 19              | その他資金流入額                                  |                                                 | 121,895      | 103,881      | 127,356      | 107,173      |
| 20              | 資金流入合計額                                   |                                                 | 599,173      | 394,287      | 600,158      | 393,655      |
| 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                            |                                                 |              | 1,943,845    |              | 2,036,209    |
| 22              | 純資金流出額                                    |                                                 |              | 1,355,435    |              | 1,389,355    |
| 23              | 単体流動性カバレッジ比率                              |                                                 |              | 143.4        |              | 146.5        |
| 24              | 平均値計算用データ数                                |                                                 | 63           |              | 62           |              |