

I. 流動性カバレッジ比率に関する定性的開示事項【連結・単体】

1. 時系列における流動性カバレッジ比率の変動に関する事項

主に「適格流動資産」が減少したことから、連結流動性カバレッジ比率は前四半期比19.2%低下の159.9%、単体流動性カバレッジ比率は前四半期比19.8%低下の162.3%となりました。

2. 流動性カバレッジ比率の水準の評価に関する事項

連結、単体ともに、規制で求められる流動性カバレッジ比率の最低水準を大きく上回っており、問題のない水準を維持しています。

3. 算入可能適格流動資産の合計額の内容に関する事項

算入可能適格流動資産については、主に債券や預け金等により構成されています。

なお、負債合計額の5%以上を占める日本円以外の通貨として「米ドル」が該当しますが、流動性カバレッジ比率の最低水準を大きく上回っており、問題ありません。

算入可能適格流動資産の構成や所在地等について、著しい変動はありません。

4. その他流動性カバレッジ比率に関する事項

「その他偶発事象に係る資金流出額」には、投資ファンドに対する未出資金等を計上しています。

「その他契約に基づく資金流出額」には、連結子会社の流動負債等を計上しています。

なお、連結流動性カバレッジ比率の算定にあたり連結子会社の取扱いについて、当該子会社が保有する適格流動資産は零、また流動負債は全額資金流出するとみなして算出しています。

「その他契約に基づく資金流入額」には、約定未受渡の無担保資金調達額等を計上しています。