

I. 流動性カバレッジ比率に関する定性的開示事項【連結・単体共通】

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

当行の流動性カバレッジ比率は、連結、単体ともに、過去2年間にわたって安定的に推移しています。

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上回っており、特段の問題はないものと考えています。
なお、流動性カバレッジ比率の実績値は、当初の見通しと大きく異なっていません。
また、今後の流動性カバレッジ比率の見通しが現在の水準から大きく乖離することは想定していません。

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おり、通貨又は種類等の構成や所在地について、著しい変動はありません。
また、主要な通貨（当該通貨建て負債合計額が、当行の負債合計額の5%以上を占める通貨）において、算入可能適格流動資産の合計額と純資金流出額の間に着しい通貨のミスマッチはありません。

4. その他流動性カバレッジ比率に関する事項

- ① 流動性比率告示第29条に定める「適格オペレーショナル預金に係る特例」は適用していません。
- ② 流動性比率告示第38条に定める「シナリオ法による時価変動時所要追加担保額」は適用していません。
- ③ 流動性比率告示第53条に定める「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。
同告示第60条に定める「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。
同告示第73条に定める「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。
- ④ 流動性カバレッジ比率（日次平均の値）に与える影響に鑑み、重要性が乏しいと考えられる項目については日次データを使用していない場合があります。

II. 安定調達比率に関する定性的開示事項【連結・単体共通】

1. 時系列における安定調達比率の変動に関する事項

「流動性比率告示」（平成26年金融庁告示第60号）の改正（令和3年9月30日適用）に基づき、初回の算出を行っていることから、主要な変動及びその要因はありません。

2. 流動性比率告示第101条各号に掲げる要件を満たす場合にはその旨

流動性比率告示第101条に定める「相互に係る資産・負債の特例」は適用していません。

3. その他安定調達比率に関する事項

連結、単体ともに、規制で求められる安定調達比率の最低水準を上回っており、特段の問題はないものと考えています。
なお、安定調達比率の実績値は、当初の見通しと大きく異なっていません。
また、今後の安定調達比率の見通しが現在の水準から大きく乖離することは想定していません。