

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

主に「算入可能適格流動資産の合計額」が低下したことから、連結流動性カバレッジ比率は前四半期比4.2ポイント低下の151.7%、単体流動性カバレッジ比率は前四半期比4.2ポイント低下の153.6%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おり、構成や所在地等について、著しい変動はありません。

また、主要な通貨において、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

「適格オペレーショナル預金に係る特例」およびデリバティブ取引等の時価変動時における所要追加担保額算出に用いる「シナリオ法」は適用していません。

「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。