（その他契約に基づく資金流出額）

**第五十九条**　第五十三条第六号に掲げる「その他契約に基づく資金流出額」とは、契約に基づく金銭の支払であって、基準日から三十日を経過する日までの間に発生するもののうち、最終指定親会社等のリスク管理上重要なもの（次項において「その他契約に基づく主要な資金流出項目」という。）の額の合計額に百パーセントの資金流出率を乗じて得た額（第十七条第一号から第八号まで及び第五十三条第一号から第五号までに掲げるものに係るものを除く。）をいう。

2　最終指定親会社等は、最終指定親会社等の流動性リスクの管理上の重要性を踏まえ、その他契約に基づく主要な資金流出項目を設定することとする。

## 第五章　資金流入

### 第一節　資金流入額

**第六十条**　資金流入額は、次に掲げる額を合計することにより算出する。

一　有担保資金運用等に係る資金流入額

二　貸付金等の回収に係る資金流入額

三　有価証券償還に係る資金流入額

四　デリバティブ取引等に係る資金流入額

五　その他資金流入額

### 第二節　有担保資金運用等に係る資金流入額

（有担保資金運用等に係る資金流入額）

**第六十一条**　前条第一号に掲げる「有担保資金運用等に係る資金流入額」とは、最終指定親会社等が現に行っているレポ形式の取引等又は中央銀行有担保資金取引（いずれも基準日から三十日を経過する日までの間に弁済期が到来するものに限る。次項において同じ。）において取引相手方に差し入れている金銭の額（未使用の担保の額及び借入枠に相当する額を除く。）に次条第一項及び第二項に定める有担保資金運用等に係る資金流入率を乗じて得た額の合計額に担保交換に係る資金流入額を加えた額をいう。

2　前項の「担保交換に係る資金流入額」とは、レポ形式の取引等又は中央銀行有担保資金取引のうち担保交換に該当するものについて、それぞれの取引について第一号に掲げる額から第二号に掲げる額を減じて得た額（当該額が零を下回る場合は、零とする。）の合計額をいう。

一　最終指定親会社等が取引相手方から有価証券を受け入れ、当該取引相手方に金銭を差し入れるレポ形式の取引等又は中央銀行有担保資金取引が行われるものとみなして、当該金銭の額に次条第一項に定める有担保資金運用等に係る資金流入率を乗じて得た額

二　最終指定親会社等が取引相手方から金銭を受け入れるレポ形式の取引等又は中央銀行有担保資金取引が行われるものとみなして、当該金銭の額に第三十二条に定める有担保資金調達等に係る資金流出率を乗じて得た額

（有担保資金運用等に係る資金流入率）

**第六十二条**　有担保資金運用等に係る資金流入率は、次の各号に掲げる区分に応じ、当該各号に定める値とする。

一　受入資産がレベル1資産であるもの　零パーセント

二　受入資産がレベル2A資産であるもの　十五パーセント

三　受入資産がレベル2B資産に該当する住宅ローン担保証券であるもの　二十五パーセント

四　受入資産がレベル2B資産であるもの（前号に掲げるものを除く。）　五十パーセント

五　受入資産が有価証券その他の資産であるもの（前各号及び次号に掲げるものを除く。）　百パーセント

六　適格流動資産以外の資産を担保とするマージン貸出に該当するもの　五十パーセント

2　前項の規定にかかわらず、カバード・ショート・ポジションにおいて用いられているレポ形式の取引等に係る資金流入率は、零パーセントとする。

### 第三節　貸付金等の回収に係る資金流入額

（貸付金等の回収に係る資金流入額）

**第六十三条**　第六十条第二号に掲げる「貸付金等の回収に係る資金流入額」とは、貸付金等回収額に係る資金流入率を乗じて得た額の合計額をいう。

2　前項の「貸付金等回収額」とは、最終指定親会社等の取引相手方に対する貸付金債権（全額が弁済される見込みが十分に高いと認められるものに限り、リボルビング形式のもの及び弁済日が定められていないものを除く。）の元本の額及び取引相手方に対する預け金（第八条第一項第二号に掲げるもの及び当該取引相手方にとってオペレーショナル預金に相当するものを除く。）の額のうち、当該取引相手方が契約に基づき基準日から三十日を経過する日までの間に弁済することが義務付けられている部分の額をいう。

（貸付金等回収額に係る資金流入率）

**第六十四条**　前条第一項の貸付金等回収額に係る資金流入率は、次の各号に掲げる取引相手方の区分に応じ、当該各号に定める値とする。

一　中央銀行等又は金融機関等　百パーセント

二　前号に掲げる取引相手方以外の者　五十パーセント

### 第四節　有価証券償還に係る資金流入額

**第六十五条**　第六十条第三号に掲げる「有価証券償還に係る資金流入額」とは、最終指定親会社等が保有する有価証券の償還金額のうち、その契約に従い基準日から三十日を経過する日までの間に取引相手方が弁済することが義務付けられている部分の額に、有価証券償還に係る資金流入率を乗じて得た額の合計額をいう。

2　前項の有価証券償還に係る資金流入率は、次の各号に掲げる有価証券の区分に応じ、当該各号に定める値とする。

一　適格流動資産　零パーセント

二　前号に掲げるもの以外の有価証券　百パーセント

### 第五節　デリバティブ取引等に係る資金流入額

**第六十六条**　第六十条第四号に掲げる「デリバティブ取引等に係る資金流入額」とは、基準日から三十日を経過する日までの間にデリバティブ取引等の契約から予想される資金流入額に百パーセントの資金流入率を乗じて得た額をいう。

2　前項の「基準日から三十日を経過する日までの間にデリバティブ取引等の契約から予想される資金流入額」とは、デリバティブ取引等の別に第三十四条第二項から第四項までの規定により計算した額のうち、零を超えないものの絶対値の合計額をいう。

### 第六節　その他資金流入額

（その他資金流入額）

**第六十七条**　第六十条第五号に掲げる「その他資金流入額」とは、次に掲げる額の合計額をいう。ただし、約定未受渡の有価証券売却及びレポ形式の取引等が一連の取引とみなされる場合における当該有価証券売却に係る資金流入額並びに約定未受渡の有価証券購入及びレポ形式の取引等が一連の取引とみなされる場合における当該レポ形式の取引等に係る資金流入額を除くことができる。

一　約定未受渡のレポ形式の取引等に係る資金流入額

二　約定未受渡の有価証券売却に係る資金流入額

三　金利、配当及び手数料等の受取に係る資金流入額

四　無担保の有価証券貸出に係る資金流入額

五　その他契約に基づく資金流入額

（約定未受渡の有価証券売却に係る資金流入額）

**第六十八条**　前条第一号に掲げる「約定未受渡の有価証券売却に係る資金流入額」とは、約定未受渡の有価証券売却（基準日から三十日を経過する日までの間において受渡しが完了するものに限る。）に基づいて最終指定親会社等が基準日から三十日を経過する日までの間に受け入れる金銭の額に、約定未受渡の有価証券売却に係る資金流入率を乗じて得た額の合計額をいう。

2　前項の約定未受渡の有価証券売却に係る資金流入率は、次の各号に掲げる有価証券の区分に応じ、当該各号に定める値とする。

一　適格流動資産　零パーセント

二　有価証券（前号に掲げるものを除く。）　百パーセント