

流動性カバレッジ比率に関する開示（三菱UFJ信託銀行・連結）

(単位：百万円、%、件)

| 項目 | | 当四半期 (2023年3月期 第3四半期) | | 前四半期 (2023年3月期 第2四半期) | |
|-------------------------|-----------------------------------------------------|--------------------------|----------------------|--------------------------|----------------------|
| 適格流動資産 (1) | | | | | |
| 1 | 適格流動資産の合計額 | 17,423,688 | | 17,694,364 | |
| 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 | 7,955,863 | 721,542 | 8,022,479 | 727,461 |
| 3 | うち、安定預金の額 | 1,063,913 | 31,917 | 1,071,216 | 32,136 |
| 4 | うち、準安定預金の額 | 6,891,950 | 689,624 | 6,951,262 | 695,325 |
| 5 | ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額 | 14,285,638 | 12,681,513 | 15,356,029 | 13,725,777 |
| 6 | うち、適格オペレーショナル預金の額 | 939,036 | 234,759 | 969,474 | 242,368 |
| 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 | 12,243,938 | 11,344,090 | 13,041,642 | 12,138,496 |
| 8 | うち、負債性有価証券の額 | 1,102,664 | 1,102,664 | 1,344,913 | 1,344,913 |
| 9 | 有担保資金調達等に係る資金流出額 | | 259,398 | | 359,425 |
| 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 | 31,146,469 | 30,821,204 | 27,355,583 | 27,031,976 |
| 11 | うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額 | 29,322,414 | 29,322,414 | 25,669,406 | 25,669,406 |
| 12 | うち、資金調達プログラムに係る資金流出額 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 13 | うち、与信・流動性ファシリティに係る資金流出額 | 1,824,055 | 1,498,790 | 1,686,177 | 1,362,570 |
| 14 | 資金提供義務に基づく資金流出額等 | 299,638 | 150,332 | 432,378 | 220,844 |
| 15 | 偶発事象に係る資金流出額 | 2,163,771 | 217,895 | 2,131,826 | 214,914 |
| 16 | 資金流出合計額 | | 44,851,888 | | 42,280,402 |
| 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 | 499,299 | 3,096 | 202,137 | 4,993 |
| 18 | 貸付金等の回収に係る資金流入額 | 2,008,800 | 1,887,015 | 1,540,853 | 1,427,423 |
| 19 | その他資金流入額 | 29,345,926 | 28,808,048 | 25,646,314 | 25,333,285 |
| 20 | 資金流入合計額 | 31,854,025 | 30,698,159 | 27,389,304 | 26,765,701 |
| 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 | | 17,423,688 | | 17,694,364 |
| 22 | 純資金流出額 | | 14,153,728 | | 15,514,700 |
| 23 | 連結流動性カバレッジ比率 | | 123.1 | | 114.0 |
| 24 | 平均値計算用データ数 | | 62 | | 62 |