

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 (2021年3月期 第3四半期) | | 前四半期 (2021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 | 15,536,897 | | 15,849,978 | |
| 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 | 8,634,529 | 786,505 | 8,756,936 | 797,466 |
| 3 | うち、安定預金の額 | 1,102,950 | 33,089 | 1,121,210 | 33,636 |
| 4 | うち、準安定預金の額 | 7,531,579 | 753,417 | 7,635,726 | 763,830 |
| 5 | ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額 | 12,660,024 | 11,240,959 | 12,941,455 | 11,505,279 |
| 6 | うち、適格オペレーショナル預金の額 | 661,342 | 165,335 | 638,052 | 159,513 |
| 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 | 11,431,594 | 10,508,535 | 11,579,782 | 10,622,144 |
| 8 | うち、負債性有価証券の額 | 567,088 | 567,088 | 723,621 | 723,621 |
| 9 | 有担保資金調達等に係る資金流出額 | | 390,368 | | 411,246 |
| 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 | 13,641,583 | 13,394,866 | 1,220,790 | 1,004,209 |
| 11 | うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額 | 12,811,714 | 12,811,714 | 479,764 | 479,764 |
| 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 | 829,870 | 583,152 | 741,026 | 524,445 |
| 14 | 資金提供義務に基づく資金流出額等 | 1,084,316 | 931,967 | 940,088 | 859,900 |
| 15 | 偶発事象に係る資金流出額 | 1,981,082 | 147,995 | 1,937,624 | 144,654 |
| 16 | 資金流出合計額 | | 26,892,660 | | 14,722,754 |
| 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 | 33,525 | 0 | 133,104 | 0 |
| 18 | 貸付金等の回収に係る資金流入額 | 1,694,280 | 1,562,656 | 1,262,491 | 1,125,132 |
| 19 | その他資金流入額 | 13,069,285 | 12,670,158 | 827,380 | 275,714 |
| 20 | 資金流入合計額 | 14,797,090 | 14,232,814 | 2,222,975 | 1,400,846 |
| 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 | | 15,536,897 | | 15,849,978 |
| 22 | 純資金流出額 | | 12,659,846 | | 13,321,909 |
| 23 | 連結流動性カバレッジ比率 | | 122.7 | | 118.9 |
| 24 | 平均値計算用データ数 | | 63 | | 61 |