

流動性カバレッジ比率に関する開示（三菱東京UFJ銀行・単体）

(単位：百万円、%、件)

| 項目 | | 当四半期 (平成29年 第2四半期) | | 前四半期 (平成29年 第1四半期) | |
|-------------------------|---|-----------------------|----------------------|-----------------------|----------------------|
| 適格流動資産 (1) | | | | | |
| 1 | 適格流動資産の合計額 | 73,116,944 | | 70,274,294 | |
| 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 | 69,118,335 | 5,894,982 | 68,143,483 | 5,834,405 |
| 3 | うち、安定預金の額 | 14,528,328 | 435,850 | 14,002,089 | 420,063 |
| 4 | うち、準安定預金の額 | 54,590,007 | 5,459,132 | 54,141,394 | 5,414,343 |
| 5 | ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額 | 66,239,595 | 33,765,348 | 66,255,589 | 33,485,203 |
| 6 | うち、適格オペレーショナル預金の額 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 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 | 63,633,599 | 31,159,353 | 63,842,387 | 31,072,001 |
| 8 | うち、負債性有価証券の額 | 2,605,996 | 2,605,996 | 2,413,202 | 2,413,202 |
| 9 | 有担保資金調達等に係る資金流出額 | | | 270,668 | 241,811 |
| 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 | 36,705,011 | 10,719,564 | 37,607,308 | 11,251,454 |
| 11 | うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額 | 2,277,881 | 2,277,881 | 2,237,936 | 2,237,936 |
| 12 | うち、資金調達プログラムに係る資金流出額 | 10,033 | 10,033 | 11,275 | 11,275 |
| 13 | うち、与信・流動性ファシリティに係る資金流出額 | 34,417,097 | 8,431,650 | 35,358,097 | 9,002,243 |
| 14 | 資金提供義務に基づく資金流出額等 | 1,830,505 | 409,401 | 1,911,618 | 394,217 |
| 15 | 偶発事象に係る資金流出額 | 52,797,343 | 463,983 | 54,789,793 | 455,297 |
| 16 | 資金流出合計額 | | | 51,523,945 | 51,662,386 |
| 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 | 1,936,712 | 0 | 2,192,675 | 0 |
| 18 | 貸付金等の回収に係る資金流入額 | 11,728,914 | 8,247,660 | 11,650,766 | 8,227,644 |
| 19 | その他資金流入額 | 4,295,021 | 773,646 | 2,990,011 | 709,680 |
| 20 | 資金流入合計額 | 17,960,647 | 9,021,306 | 16,833,451 | 8,937,324 |
| 単体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 | 73,116,944 | | 70,274,294 | |
| 22 | 純資金流出額 | 42,502,639 | | 42,725,063 | |
| 23 | 単体流動性カバレッジ比率 | 172.0 | | 164.4 | |
| 24 | 平均値計算用データ数 | 62 | | 62 | |