

## 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 (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	16,576,553		16,389,476	
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	10,043,910	916,795	9,963,898	909,968
3	うち、安定預金の額	1,255,752	37,673	1,238,992	37,170
4	うち、準安定預金の額	8,788,158	879,123	8,724,907	872,798
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	15,034,962	13,793,005	14,590,996	13,346,601
6	うち、適格オペレーショナル預金の額	95,431	23,858	102,786	25,697
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	12,997,664	11,827,280	12,696,051	11,528,746
8	うち、負債性有価証券の額	1,941,867	1,941,867	1,792,158	1,792,158
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		65,863		79,799
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	2,424,334	858,136	2,453,677	884,021
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	566,966	566,966	603,755	603,755
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	1,857,368	291,170	1,849,922	280,267
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	1,323,275	1,113,076	1,252,191	1,043,906
15	偶発事象に係る資金流出額	6,391,164	70,828	6,369,321	67,600
16	資金流出合計額		16,817,703		16,331,894
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	533,905	0	828,359	0
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	2,358,777	1,824,404	2,178,270	1,641,912
19	その他資金流入額	1,403,049	486,914	1,580,156	418,608
20	資金流入合計額	4,295,731	2,311,318	4,586,785	2,060,520
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		16,576,553		16,389,476
22	純資金流出額		14,506,385		14,271,374
23	連結流動性カバレッジ比率		114.2		114.8
24	平均値計算用データ数		62		62