

流動性カバレッジ比率に関する定量的開示事項

株式会社三井住友銀行（単体）

（単位：百万円、%、件）

| 項目              |                                                     | 当四半期<br>(2023年度第2四半期) |                      | 前四半期<br>(2023年度第1四半期) |                      |
|-----------------|-----------------------------------------------------|-----------------------|----------------------|-----------------------|----------------------|
| 適格流動資産（1）       |                                                     |                       |                      |                       |                      |
| 1               | 適格流動資産の合計額                                          | 76,507,159            |                      | 75,425,982            |                      |
| 資金流出額（2）        |                                                     | 資金流出率<br>を乗じる前<br>の額  | 資金流出率<br>を乗じた後<br>の額 | 資金流出率<br>を乗じる前<br>の額  | 資金流出率<br>を乗じた後<br>の額 |
| 2               | リテール無担保資金調達に係る資金流出額                                 | 59,011,316            | 4,542,981            | 58,106,035            | 4,492,290            |
| 3               | うち、安定預金の額                                           | 19,411,068            | 582,332              | 18,842,054            | 565,261              |
| 4               | うち、準安定預金の額                                          | 39,600,248            | 3,960,649            | 39,263,980            | 3,927,029            |
| 5               | ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額                               | 87,743,072            | 44,086,842           | 89,108,817            | 44,636,942           |
| 6               | うち、適格オペレーショナル預金の額                                   | —                     | —                    | —                     | —                    |
| 7               | うち、適格オペレーショナル預金及び負債性有価証券<br>以外のホールセール無担保資金調達に係る資金の額 | 81,266,827            | 37,610,596           | 82,531,561            | 38,059,687           |
| 8               | うち、負債性有価証券の額                                        | 6,476,245             | 6,476,245            | 6,577,255             | 6,577,255            |
| 9               | 有担保資金調達等に係る資金流出額                                    |                       | 237,701              |                       | 235,291              |
| 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<br>性ファシリティに係る資金流出額       | 33,268,600            | 11,712,943           | 31,467,267            | 10,914,171           |
| 11              | うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額                                | 709,847               | 709,847              | 697,066               | 697,066              |
| 12              | うち、資金調達プログラムに係る資金流出額                                | 411,119               | 411,119              | 407,430               | 407,430              |
| 13              | うち、与信・流動性ファシリティに係る資金流出額                             | 32,147,633            | 10,591,977           | 30,362,770            | 9,809,674            |
| 14              | 資金提供義務に基づく資金流出額等                                    | 8,161,572             | 3,918,529            | 8,351,338             | 4,614,374            |
| 15              | 偶発事象に係る資金流出額                                        | 82,666,719            | 2,204,204            | 81,721,627            | 1,800,864            |
| 16              | 資金流出合計額                                             |                       | 66,703,204           |                       | 66,693,935           |
| 資金流入額（3）        |                                                     | 資金流入率<br>を乗じる前<br>の額  | 資金流入率<br>を乗じた後<br>の額 | 資金流入率<br>を乗じる前<br>の額  | 資金流入率<br>を乗じた後<br>の額 |
| 17              | 有担保資金運用等に係る資金流入額                                    | 1,730,113             | 70,295               | 1,227,931             | 35,304               |
| 18              | 貸付金等の回収に係る資金流入額                                     | 15,695,257            | 11,656,806           | 14,352,875            | 10,658,793           |
| 19              | その他資金流入額                                            | 2,767,882             | 1,522,982            | 2,791,868             | 1,482,046            |
| 20              | 資金流入合計額                                             | 20,193,253            | 13,250,084           | 18,372,676            | 12,176,144           |
| 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                                      |                       | 76,507,159           |                       | 75,425,982           |
| 22              | 純資金流出額                                              |                       | 53,453,119           |                       | 54,517,791           |
| 23              | 単体流動性カバレッジ比率                                        |                       | 143.1%               |                       | 138.3%               |
| 24              | 平均値計算用データ数                                          | 62                    |                      | 62                    |                      |