

流動性カバレッジ比率に関する定量的開示事項

株式会社三井住友フィナンシャルグループ（連結）

（単位：百万円、%、件）

| 項目              |                                                     | 当四半期<br>(2023年度第4四半期) |                      | 前四半期<br>(2023年度第3四半期) |                      |
|-----------------|-----------------------------------------------------|-----------------------|----------------------|-----------------------|----------------------|
| 適格流動資産（1）       |                                                     |                       |                      |                       |                      |
| 1               | 適格流動資産の合計額                                          | 86,516,063            |                      | 87,422,115            |                      |
| 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                                 | 63,443,579            | 4,923,897            | 62,845,227            | 4,892,409            |
| 3               | うち、安定預金の額                                           | 20,341,415            | 613,074              | 19,934,640            | 600,736              |
| 4               | うち、準安定預金の額                                          | 43,102,163            | 4,310,822            | 42,910,586            | 4,291,672            |
| 5               | ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額                               | 95,792,027            | 48,320,101           | 94,161,546            | 46,887,991           |
| 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 | 88,876,677            | 41,404,751           | 88,225,105            | 40,951,550           |
| 8               | うち、負債性有価証券の額                                        | 6,915,349             | 6,915,349            | 5,936,441             | 5,936,441            |
| 9               | 有担保資金調達等に係る資金流出額                                    |                       | 595,577              |                       | 397,113              |
| 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       | 39,596,495            | 14,389,119           | 39,048,777            | 14,238,756           |
| 11              | うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額                                | 2,214,702             | 2,214,702            | 2,226,124             | 2,226,124            |
| 12              | うち、資金調達プログラムに係る資金流出額                                | 390,248               | 390,248              | 478,837               | 478,837              |
| 13              | うち、与信・流動性ファシリティに係る資金流出額                             | 36,991,543            | 11,784,168           | 36,343,816            | 11,533,794           |
| 14              | 資金提供義務に基づく資金流出額等                                    | 12,655,757            | 9,018,167            | 11,756,040            | 8,368,628            |
| 15              | 偶発事象に係る資金流出額                                        | 87,751,299            | 2,248,973            | 87,462,675            | 2,236,905            |
| 16              | 資金流出合計額                                             |                       | 79,495,836           |                       | 77,021,804           |
| 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                                    | 10,691,925            | 1,017,005            | 9,705,981             | 935,744              |
| 18              | 貸付金等の回収に係る資金流入額                                     | 15,057,425            | 9,522,642            | 12,916,581            | 8,238,313            |
| 19              | その他資金流入額                                            | 5,478,710             | 3,035,047            | 5,961,186             | 2,842,503            |
| 20              | 資金流入合計額                                             | 31,228,061            | 13,574,694           | 28,583,748            | 12,016,561           |
| 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                                      |                       | 86,516,063           |                       | 87,422,115           |
| 22              | 純資金流出額                                              |                       | 65,921,141           |                       | 65,005,243           |
| 23              | 連結流動性カバレッジ比率                                        |                       | 131.2%               |                       | 134.4%               |
| 24              | 平均値計算用データ数                                          | 58                    |                      | 62                    |                      |