

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                                          | 85,233,221            |                      | 83,567,395            |                      |
| 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                                 | 62,644,923            | 4,870,687            | 61,588,069            | 4,805,809            |
| 3               | うち、安定預金の額                                           | 19,953,868            | 600,957              | 19,366,400            | 583,011              |
| 4               | うち、準安定預金の額                                          | 42,691,055            | 4,269,729            | 42,221,669            | 4,222,798            |
| 5               | ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額                               | 93,516,663            | 46,936,784           | 94,349,500            | 47,127,009           |
| 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 | 86,713,002            | 40,133,122           | 87,620,020            | 40,397,528           |
| 8               | うち、負債性有価証券の額                                        | 6,803,661             | 6,803,661            | 6,729,480             | 6,729,480            |
| 9               | 有担保資金調達等に係る資金流出額                                    |                       | 518,232              |                       | 424,599              |
| 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       | 38,171,940            | 13,889,856           | 35,929,555            | 12,883,208           |
| 11              | うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額                                | 2,313,266             | 2,313,266            | 2,243,598             | 2,243,598            |
| 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                             | 35,447,554            | 11,165,470           | 33,278,526            | 10,232,179           |
| 14              | 資金提供義務に基づく資金流出額等                                    | 12,052,774            | 8,589,140            | 11,990,304            | 9,181,899            |
| 15              | 偶発事象に係る資金流出額                                        | 86,128,712            | 2,419,817            | 85,298,927            | 2,008,695            |
| 16              | 資金流出合計額                                             |                       | 77,224,519           |                       | 76,431,221           |
| 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                                    | 9,813,224             | 990,324              | 7,999,307             | 729,062              |
| 18              | 貸付金等の回収に係る資金流入額                                     | 14,472,541            | 9,639,027            | 13,650,863            | 9,181,144            |
| 19              | その他資金流入額                                            | 5,165,362             | 3,017,774            | 5,300,081             | 2,909,928            |
| 20              | 資金流入合計額                                             | 29,451,128            | 13,647,126           | 26,950,252            | 12,820,135           |
| 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                                      |                       | 85,233,221           |                       | 83,567,395           |
| 22              | 純資金流出額                                              |                       | 63,577,392           |                       | 63,611,086           |
| 23              | 連結流動性カバレッジ比率                                        |                       | 134.0%               |                       | 131.3%               |
| 24              | 平均値計算用データ数                                          | 62                    |                      | 62                    |                      |