流動性カバレッジ比率に関する定量的開示事項（平成29年3月期第4四半期）

【三井住友トラスト・ホールディングス】
（連結・国際統一基準）
（単位：百万円、%、件）

<table>
<thead>
<tr>
<th>項目</th>
<th>当四半期</th>
<th>前四半期</th>
</tr>
</thead>
<tbody>
<tr>
<td>適格流動資産（1）</td>
<td></td>
<td></td>
</tr>
<tr>
<td>1 適格流動資産の合計額</td>
<td>23,979,032</td>
<td>22,382,684</td>
</tr>
<tr>
<td>資金流出額（2）</td>
<td></td>
<td></td>
</tr>
<tr>
<td>2 リテール無担保資金調達に係る資金流出額</td>
<td>17,762,805</td>
<td>16,767,272</td>
</tr>
<tr>
<td>3 うち、安定預金の額</td>
<td>582,023</td>
<td>16,469</td>
</tr>
<tr>
<td>4 うち、準安定預金の額</td>
<td>7,035,487</td>
<td>6,167,001</td>
</tr>
<tr>
<td>5 ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額</td>
<td>22,294,450</td>
<td>24,367,556</td>
</tr>
<tr>
<td>6 うち、適格オペレーショナル預金の額</td>
<td>805,030</td>
<td>770,728</td>
</tr>
<tr>
<td>7 うち、適格オペレーショナル預金、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流出額</td>
<td>19,445,378</td>
<td>21,533,478</td>
</tr>
<tr>
<td>8 うち、負債性有価証券の額</td>
<td>2,044,042</td>
<td>2,063,352</td>
</tr>
<tr>
<td>9 有担保資金調達等に係る資金流出額</td>
<td>2,044,042</td>
<td>2,063,352</td>
</tr>
<tr>
<td>10 デリバティブ取引等、資金調達プログラム、与信・流動性ファシリティに係る資金流出額</td>
<td>5,299,803</td>
<td>5,510,351</td>
</tr>
<tr>
<td>11 うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額</td>
<td>606,870</td>
<td>775,060</td>
</tr>
<tr>
<td>12 うち、資金調達プログラムに係る資金流出額</td>
<td>0</td>
<td>0</td>
</tr>
<tr>
<td>13 うち、与信・流動性ファシリティに係る資金流出額</td>
<td>4,692,933</td>
<td>4,735,291</td>
</tr>
<tr>
<td>14 資金提供義務等に基づく資金流出額</td>
<td>431,238</td>
<td>692,502</td>
</tr>
<tr>
<td>15 偶発事象に係る資金流出額</td>
<td>10,296,764</td>
<td>10,524,912</td>
</tr>
<tr>
<td>16 資金流出合計額</td>
<td>20,819,038</td>
<td>21,754,584</td>
</tr>
<tr>
<td>資金流入額（3）</td>
<td></td>
<td></td>
</tr>
<tr>
<td>17 有担保資金運用等に係る資金流入額</td>
<td>44,876</td>
<td>40,943</td>
</tr>
<tr>
<td>18 貸付金等の回収に係る資金流入額</td>
<td>4,845,619</td>
<td>4,468,406</td>
</tr>
<tr>
<td>19 その他資金流入額</td>
<td>313,559</td>
<td>528,178</td>
</tr>
<tr>
<td>20 資金流入合計額</td>
<td>5,294,054</td>
<td>5,021,043</td>
</tr>
<tr>
<td>連結流動性カバレッジ比率（4）</td>
<td></td>
<td></td>
</tr>
<tr>
<td>21 算入可能適格流動資産の合計額</td>
<td>23,979,032</td>
<td>22,382,684</td>
</tr>
<tr>
<td>22 純資金流出額</td>
<td>17,535,781</td>
<td>18,398,478</td>
</tr>
<tr>
<td>23 連結流動性カバレッジ比率</td>
<td>136.7</td>
<td>121.9</td>
</tr>
<tr>
<td>24 平均値計算用データ数</td>
<td>61</td>
<td>3</td>
</tr>
</tbody>
</table>