

流動性カバレッジ比率に関する定量的開示事項(2021年3月期第1四半期)

【三井住友信託銀行】

(連結・国際統一基準)

(単位:百万円、%、件)

項目		当四半期		前四半期	
適格流動資産 (1)					
1	適格流動資産の合計額	13,694,560		14,412,361	
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	17,942,456	841,875	17,914,127	830,981
3	うち、安定預金の額	735,409	22,062	723,125	21,693
4	うち、準安定預金の額	8,157,764	819,813	8,052,225	809,287
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	12,813,688	10,509,075	12,984,336	10,581,603
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以外のホールセール無担保資金調達に係る資金の額	10,608,334	8,303,721	10,501,879	8,099,146
8	うち、負債性有価証券の額	2,205,354	2,205,354	2,482,457	2,482,457
9	有担保資金調達等に係る資金流出額	108,950		113,698	
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	5,788,145	1,638,593	5,388,536	1,546,383
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	334,674	334,674	333,644	333,644
12	うち、資金調達プログラムに係る資金流出額	—	—	—	—
13	うち、与信・流動性ファシリティに係る資金流出額	5,453,471	1,303,919	5,054,892	1,212,739
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	418,304	252,621	505,285	349,791
15	偶発事象に係る資金流出額	10,749,934	23,709	10,947,809	21,830
16	資金流出合計額	13,374,823		13,444,286	
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	473,934	6,377	107,077	746
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	2,630,945	1,787,715	2,790,920	1,857,979
19	その他資金流入額	516,487	212,841	504,121	307,459
20	資金流入合計額	3,621,366	2,006,933	3,402,118	2,166,184
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	13,694,560		14,412,361	
22	純資金流出額	11,367,890		11,278,102	
23	連結流動性カバレッジ比率	120.4		127.7	
24	平均値計算用データ数	61		58	