

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2四半期)

【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	17,953,290		13,694,560	
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	18,037,241	857,095	17,942,456	841,875
3	うち、安定預金の額	769,901	23,097	735,409	22,062
4	うち、準安定預金の額	8,301,187	833,998	8,157,764	819,813
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	13,335,886	10,519,740	12,813,688	10,509,075
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	10,973,207	8,157,061	10,608,334	8,303,721
8	うち、負債性有価証券の額	2,362,679	2,362,679	2,205,354	2,205,354
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		56,526		108,950
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	6,372,472	1,697,577	5,788,145	1,638,593
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	338,398	338,398	334,674	334,674
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	6,034,074	1,359,179	5,453,471	1,303,919
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	337,568	216,728	418,304	252,621
15	偶発事象に係る資金流出額	11,359,679	22,293	10,749,934	23,709
16	資金流出合計額		13,369,959		13,374,823
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	76,808	—	473,934	6,377
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	2,977,314	2,118,404	2,630,945	1,787,715
19	その他資金流入額	389,837	249,436	516,487	212,841
20	資金流入合計額	3,443,959	2,367,840	3,621,366	2,006,933
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		17,953,290		13,694,560
22	純資金流出額		11,002,119		11,367,890
23	連結流動性カバレッジ比率		163.1		120.4
24	平均値計算用データ数		61		61