

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】

(単体・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	17,661,017		13,401,434	
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	18,037,282	857,107	17,942,489	841,885
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	8,301,228	834,010	8,157,797	819,823
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	12,963,803	10,136,607	12,433,295	10,128,872
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	10,719,883	7,892,687	10,365,961	8,061,538
8	うち、負債性有価証券の額	2,243,920	2,243,920	2,067,334	2,067,334
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	5,502,894	1,613,581	4,953,398	1,568,748
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	293,449	293,449	302,502	302,502
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	5,209,445	1,320,132	4,650,896	1,266,246
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	286,408	165,602	351,833	186,194
15	偶発事象に係る資金流出額	13,107,681	22,690	12,308,560	23,801
16	資金流出合計額	12,852,113		12,858,450	
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	3,297,919	2,476,146	3,131,260	2,337,371
19	その他資金流入額	370,563	236,131	513,209	211,231
20	資金流入合計額	3,745,290	2,712,277	4,118,403	2,554,979
単体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	17,661,017		13,401,434	
22	純資金流出額	10,139,836		10,303,471	
23	単体流動性カバレッジ比率	174.1		130.0	
24	平均値計算用データ数	61		61	