

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)

| 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 | 13,282,518 | 10,466,644 | 12,678,214 | 10,373,971 |
| 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 | 10,951,576 | 8,135,702 | 10,577,041 | 8,272,798 |
| 8 | うち、負債性有価証券の額 | 2,330,942 | 2,330,942 | 2,101,173 | 2,101,173 |
| 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 | 6,367,472 | 1,695,577 | 5,783,145 | 1,636,593 |
| 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 | 6,029,074 | 1,357,179 | 5,448,471 | 1,301,919 |
| 14 | 資金提供義務に基づく資金流出額等 | 359,284 | 238,444 | 438,144 | 272,461 |
| 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 | | 13,336,579 | | 13,257,559 |
| 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 | | 10,968,739 | | 11,250,626 |
| 23 | 連結流動性カバレッジ比率 | | 163.6 | | 121.7 |
| 24 | 平均値計算用データ数 | | 61 | | 61 |