

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3四半期)

【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	17,832,318		17,661,017	
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	18,077,351	854,134	18,037,282	857,107
3	うち、安定預金の額	777,642	23,329	769,901	23,097
4	うち、準安定預金の額	8,268,267	830,805	8,301,228	834,010
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	12,393,563	9,496,398	12,963,803	10,136,607
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	9,833,692	6,936,527	10,719,883	7,892,687
8	うち、負債性有価証券の額	2,559,871	2,559,871	2,243,920	2,243,920
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		47,643		56,526
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	5,421,898	1,443,745	5,502,894	1,613,581
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	280,585	280,585	293,449	293,449
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	5,141,313	1,163,160	5,209,445	1,320,132
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	269,229	138,373	286,408	165,602
15	偶発事象に係る資金流出額	13,094,937	22,344	13,107,681	22,690
16	資金流出合計額		12,002,637		12,852,113
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	222,683	—	76,808	—
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	3,525,854	2,817,645	3,297,919	2,476,146
19	その他資金流入額	534,003	210,984	370,563	236,131
20	資金流入合計額	4,282,540	3,028,629	3,745,290	2,712,277
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		17,832,318		17,661,017
22	純資金流出額		8,974,008		10,139,836
23	単体流動性カバレッジ比率		198.7		174.1
24	平均値計算用データ数		63		61