

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4四半期)

【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	17,824,739		17,832,318	
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	18,100,693	856,671	18,077,351	854,134
3	うち、安定預金の額	797,884	23,936	777,642	23,329
4	うち、準安定預金の額	8,296,187	832,734	8,268,267	830,805
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	12,933,140	10,002,083	12,393,563	9,496,398
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	10,210,265	7,279,208	9,833,692	6,936,527
8	うち、負債性有価証券の額	2,722,875	2,722,875	2,559,871	2,559,871
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		108,049		47,643
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	5,563,277	1,530,867	5,421,898	1,443,745
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	307,082	307,082	280,585	280,585
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	5,256,195	1,223,785	5,141,313	1,163,160
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	357,046	154,469	269,229	138,373
15	偶発事象に係る資金流出額	12,980,376	22,098	13,094,937	22,344
16	資金流出合計額		12,674,237		12,002,637
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	75,135	—	222,683	—
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	3,292,553	2,455,890	3,525,854	2,817,645
19	その他資金流入額	602,231	225,192	534,003	210,984
20	資金流入合計額	3,969,919	2,681,082	4,282,540	3,028,629
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		17,824,739		17,832,318
22	純資金流出額		9,993,155		8,974,008
23	単体流動性カバレッジ比率		178.3		198.7
24	平均値計算用データ数		60		63