

流動性カバレッジ比率に関する定量的開示事項(2022年3月期第1四半期)

【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	18,228,161		18,052,471	
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	18,215,935	866,917	18,100,666	856,663
3	うち、安定預金の額	807,178	24,215	797,884	23,936
4	うち、準安定預金の額	8,394,781	842,702	8,296,160	832,727
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	12,034,498	9,405,539	13,364,313	10,430,071
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	9,280,623	6,651,664	10,467,313	7,533,071
8	うち、負債性有価証券の額	2,753,875	2,753,875	2,897,000	2,897,000
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		80,141		108,049
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	6,425,368	1,603,162	6,459,374	1,611,852
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	340,517	340,517	346,926	346,926
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	6,084,851	1,262,645	6,112,448	1,264,926
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	553,708	392,677	428,703	226,079
15	偶発事象に係る資金流出額	11,277,089	23,356	11,362,848	21,699
16	資金流出合計額		12,371,792		13,254,413
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	49,869	—	75,135	—
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	3,105,968	2,376,011	2,938,462	2,068,627
19	その他資金流入額	553,629	275,008	645,441	264,966
20	資金流入合計額	3,709,466	2,651,019	3,659,038	2,333,593
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		18,228,161		18,052,471
22	純資金流出額		9,720,773		10,920,820
23	連結流動性カバレッジ比率		187.5		165.3
24	平均値計算用データ数		61		60