

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】

(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	17,994,265		17,824,739	
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	18,215,989	866,933	18,100,693	856,671
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	8,394,835	842,717	8,296,187	832,734
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	11,616,906	8,999,615	12,933,140	10,002,083
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	8,982,344	6,365,053	10,210,265	7,279,208
8	うち、負債性有価証券の額	2,634,562	2,634,562	2,722,875	2,722,875
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	5,520,109	1,527,406	5,563,277	1,530,867
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	310,390	310,390	307,082	307,082
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	5,209,719	1,217,016	5,256,195	1,223,785
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	406,754	245,778	357,046	154,469
15	偶発事象に係る資金流出額	12,808,563	23,750	12,980,376	22,098
16	資金流出合計額		11,743,623		12,674,237
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	3,473,372	2,783,352	3,292,553	2,455,890
19	その他資金流入額	520,862	243,982	602,231	225,192
20	資金流入合計額	4,044,103	3,027,334	3,969,919	2,681,082
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		17,994,265		17,824,739
22	純資金流出額		8,716,289		9,993,155
23	単体流動性カバレッジ比率		206.4		178.3
24	平均値計算用データ数		61		60