

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3四半期)

【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	18,165,813		18,094,605	
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	18,745,038	935,154	18,781,567	940,105
3	うち、安定預金の額	842,978	25,289	835,636	25,069
4	うち、準安定預金の額	9,070,562	909,864	9,121,058	915,036
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	11,820,102	9,266,276	12,424,315	9,727,466
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	9,147,337	6,593,511	9,538,759	6,841,910
8	うち、負債性有価証券の額	2,672,765	2,672,765	2,885,556	2,885,556
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		16,598		20,280
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	6,070,323	1,675,640	6,041,350	1,633,664
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	710,573	710,573	706,951	706,951
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	5,359,750	965,067	5,334,399	926,713
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	799,460	641,829	778,381	584,748
15	偶発事象に係る資金流出額	11,078,567	21,489	11,160,662	22,171
16	資金流出合計額		12,556,986		12,928,434
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	55,209	—	55,788	—
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	3,683,115	2,911,143	3,062,169	2,243,918
19	その他資金流入額	595,325	455,359	664,724	442,437
20	資金流入合計額	4,333,649	3,366,502	3,782,681	2,686,355
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		18,165,813		18,094,605
22	純資金流出額		9,190,484		10,242,079
23	連結流動性カバレッジ比率		197.6		176.6
24	平均値計算用データ数		63		61

(注) 上記期間において、日次データを用いるべき項目の一部を月末データで代用し、算出しております。