

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】

(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		17,911,071	17,850,810	
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	18,745,050	935,163	18,781,579	940,114
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	9,070,574	909,874	9,121,070	915,045
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	11,315,687	8,786,522	12,000,703	9,325,297
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	8,800,462	6,271,297	9,222,652	6,547,246
8	うち、負債性有価証券の額	2,515,225	2,515,225	2,778,051	2,778,051
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	5,176,143	1,623,477	5,178,850	1,610,983
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	677,668	677,668	669,441	669,441
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	4,498,475	945,809	4,509,409	941,542
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	622,345	464,751	593,801	401,861
15	偶発事象に係る資金流出額	12,627,690	21,897	12,700,225	22,573
16	資金流出合計額		11,848,408		12,321,108
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	3,940,639	3,210,486	3,388,641	2,607,120
19	その他資金流入額	560,420	421,500	622,548	403,649
20	資金流入合計額	4,556,268	3,631,986	4,066,977	3,010,769
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		17,911,071	17,850,810	
22	純資金流出額		8,216,422	9,310,339	
23	単体流動性カバレッジ比率		217.9	191.7	
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。