

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4四半期)

【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	17,729,217		18,165,813	
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	18,934,361	885,843	18,745,038	935,154
3	うち、安定預金の額	1,774,400	53,232	842,978	25,289
4	うち、準安定預金の額	8,322,704	832,611	9,070,562	909,864
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	13,448,254	10,200,765	11,820,102	9,266,276
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	10,069,728	6,822,238	9,147,337	6,593,511
8	うち、負債性有価証券の額	3,378,526	3,378,526	2,672,765	2,672,765
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		9,960		16,598
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	6,244,437	1,832,165	6,070,323	1,675,640
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	789,784	789,784	710,573	710,573
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	5,454,652	1,042,381	5,359,750	965,067
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	346,296	279,924	799,460	641,829
15	偶発事象に係る資金流出額	631,953	17,114	11,078,567	21,489
16	資金流出合計額		13,225,773		12,556,986
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	246,948	—	55,209	—
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	2,667,575	1,845,730	3,683,115	2,911,143
19	その他資金流入額	607,529	294,099	595,325	455,359
20	資金流入合計額	3,522,053	2,139,830	4,333,649	3,366,502
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		17,729,217		18,165,813
22	純資金流出額		11,085,943		9,190,484
23	連結流動性カバレッジ比率		159.9		197.6
24	平均値計算用データ数		59		63

(注) 前四半期において、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。