

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】

(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	17,487,539		17,911,071	
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	18,745,050	935,163
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	8,322,705	832,611	9,070,574	909,874
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	12,985,400	9,766,987	11,315,687	8,786,522
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	9,759,631	6,541,219	8,800,462	6,271,297
8	うち、負債性有価証券の額	3,225,768	3,225,768	2,515,225	2,515,225
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	5,353,637	1,798,410	5,176,143	1,623,477
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	728,479	728,479	677,668	677,668
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	4,625,158	1,069,931	4,498,475	945,809
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	354,456	288,085	622,345	464,751
15	偶発事象に係る資金流出額	639,149	17,468	12,627,690	21,897
16	資金流出合計額		12,766,756		11,848,408
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	2,669,850	1,890,207	3,940,639	3,210,486
19	その他資金流入額	602,476	292,599	560,420	421,500
20	資金流入合計額	3,519,275	2,182,806	4,556,268	3,631,986
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		17,487,539		17,911,071
22	純資金流出額		10,583,950		8,216,422
23	単体流動性カバレッジ比率		165.2		217.9
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。