

流動性カバレッジ比率に関する定量的開示事項(2023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	18,013,261		17,487,539	
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	19,038,295	898,598	18,934,361	885,843
3	うち、安定預金の額	1,781,123	53,433	1,774,400	53,232
4	うち、準安定預金の額	8,448,181	845,165	8,322,705	832,611
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	13,884,583	10,675,152	12,985,400	9,766,987
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	10,766,991	7,557,561	9,759,631	6,541,219
8	うち、負債性有価証券の額	3,117,591	3,117,591	3,225,768	3,225,768
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		9,209		9,960
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	5,830,028	2,125,028	5,353,637	1,798,410
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	887,265	887,265	728,479	728,479
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	4,942,762	1,237,763	4,625,158	1,069,931
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	379,755	323,140	354,456	288,085
15	偶発事象に係る資金流出額	652,765	17,745	639,149	17,468
16	資金流出合計額		14,048,875		12,766,756
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	223,239	—	246,948	—
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	2,207,401	1,508,044	2,669,850	1,890,207
19	その他資金流入額	813,027	451,577	602,476	292,599
20	資金流入合計額	3,243,668	1,959,622	3,519,275	2,182,806
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		18,013,261		17,487,539
22	純資金流出額		12,089,252		10,583,950
23	単体流動性カバレッジ比率		149.0		165.2
24	平均値計算用データ数		61		59