

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2四半期)

【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	19,092,731		18,252,532	
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	19,123,412	918,595	19,038,291	898,598
3	うち、安定預金の額	1,807,223	54,216	1,781,123	53,433
4	うち、準安定預金の額	8,640,725	864,378	8,448,177	845,164
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	14,725,218	11,487,331	14,337,837	11,095,816
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	11,045,668	7,807,780	11,099,201	7,857,180
8	うち、負債性有価証券の額	3,679,550	3,679,550	3,238,635	3,238,635
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		15,361		9,209
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	7,135,435	2,406,008	6,740,218	2,162,599
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	1,064,895	1,064,895	947,818	947,818
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	6,070,540	1,341,113	5,792,400	1,214,780
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	214,862	158,152	373,622	316,645
15	偶発事象に係る資金流出額	657,359	17,623	645,330	17,386
16	資金流出合計額		15,003,072		14,500,254
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	282,589	—	223,239	—
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	2,593,151	1,719,007	2,227,657	1,478,284
19	その他資金流入額	745,888	452,116	818,440	454,677
20	資金流入合計額	3,621,629	2,171,124	3,269,337	1,932,962
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		19,092,731		18,252,532
22	純資金流出額		12,831,948		12,567,292
23	連結流動性カバレッジ比率		148.7		145.2
24	平均値計算用データ数		62		61