

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】

(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 | | 18,813,231 | 18,013,261 | |
| 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 | 19,038,295 | 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 | 8,448,181 | 845,165 |
| 5 | ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額 | 14,254,678 | 11,056,562 | 13,884,583 | 10,675,152 |
| 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 | 10,697,025 | 7,498,908 | 10,766,991 | 7,557,561 |
| 8 | うち、負債性有価証券の額 | 3,557,653 | 3,557,653 | 3,117,591 | 3,117,591 |
| 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 | 6,167,856 | 2,329,295 | 5,830,028 | 2,125,028 |
| 11 | うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額 | 980,549 | 980,549 | 887,265 | 887,265 |
| 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 | 5,187,306 | 1,348,745 | 4,942,762 | 1,237,763 |
| 14 | 資金提供義務に基づく資金流出額等 | 220,911 | 164,200 | 379,755 | 323,140 |
| 15 | 偶発事象に係る資金流出額 | 665,372 | 17,993 | 652,765 | 17,745 |
| 16 | 資金流出合計額 | | 14,502,008 | | 14,048,875 |
| 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 | 2,676,100 | 1,850,676 | 2,207,401 | 1,508,044 |
| 19 | その他資金流入額 | 708,242 | 414,644 | 813,027 | 451,577 |
| 20 | 資金流入合計額 | 3,666,932 | 2,265,320 | 3,243,668 | 1,959,622 |
| 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 | | 18,813,231 | 18,013,261 | |
| 22 | 純資金流出額 | | 12,236,688 | 12,089,252 | |
| 23 | 単体流動性カバレッジ比率 | | 153.7 | 149.0 | |
| 24 | 平均値計算用データ数 | | 62 | 61 | |