

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	