

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3四半期)

【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	19,077,215		18,813,231	
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	19,051,934	914,814	19,123,412	918,595
3	うち、安定預金の額	1,788,463	53,653	1,807,223	54,216
4	うち、準安定預金の額	8,608,609	861,160	8,640,725	864,378
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	14,140,359	11,021,485	14,254,678	11,056,562
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	11,058,798	7,939,924	10,697,025	7,498,908
8	うち、負債性有価証券の額	3,081,560	3,081,560	3,557,653	3,557,653
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		702		15,361
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	6,526,041	2,536,808	6,167,856	2,329,295
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	1,159,723	1,159,723	980,549	980,549
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	5,366,317	1,377,085	5,187,306	1,348,745
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	243,637	171,771	220,911	164,200
15	偶発事象に係る資金流出額	670,997	18,084	665,372	17,993
16	資金流出合計額		14,663,665		14,502,008
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	230,742	—	282,589	—
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	2,586,303	1,807,940	2,676,100	1,850,676
19	その他資金流入額	530,104	414,262	708,242	414,644
20	資金流入合計額	3,347,150	2,222,203	3,666,932	2,265,320
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		19,077,215		18,813,231
22	純資金流出額		12,441,462		12,236,688
23	単体流動性カバレッジ比率		153.3		153.7
24	平均値計算用データ数		62		62