

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)

【三井住友トラスト・ホールディングス】

(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 | 19,347,711 | | 19,092,731 | |
| 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 | 14,664,765 | 11,506,303 | 14,654,861 | 11,416,974 |
| 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 | 11,393,428 | 8,234,967 | 11,009,585 | 7,771,698 |
| 8 | うち、負債性有価証券の額 | 3,271,336 | 3,271,336 | 3,645,276 | 3,645,276 |
| 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 | 7,475,551 | 2,581,495 | 7,130,435 | 2,404,008 |
| 11 | うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額 | 1,237,270 | 1,237,270 | 1,064,895 | 1,064,895 |
| 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 | 6,238,280 | 1,344,224 | 6,065,540 | 1,339,113 |
| 14 | 資金提供義務に基づく資金流出額等 | 236,298 | 164,432 | 225,866 | 169,156 |
| 15 | 偶発事象に係る資金流出額 | 662,611 | 17,706 | 657,359 | 17,623 |
| 16 | 資金流出合計額 | | 15,185,455 | | 14,941,719 |
| 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 | 2,526,458 | 1,704,190 | 2,593,151 | 1,719,007 |
| 19 | その他資金流入額 | 554,542 | 438,073 | 745,888 | 452,116 |
| 20 | 資金流入合計額 | 3,311,743 | 2,142,263 | 3,621,629 | 2,171,124 |
| 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 | | 19,347,711 | | 19,092,731 |
| 22 | 純資金流出額 | | 13,043,191 | | 12,770,595 |
| 23 | 連結流動性カバレッジ比率 | | 148.3 | | 149.5 |
| 24 | 平均値計算用データ数 | | 62 | | 62 |