

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4四半期)

【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	19,451,554		19,347,711	
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	19,095,882	902,830	19,051,934	914,814
3	うち、安定預金の額	1,786,650	53,599	1,788,463	53,653
4	うち、準安定預金の額	8,488,939	849,230	8,608,609	861,160
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	15,888,004	12,468,394	14,728,175	11,569,713
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	12,197,771	8,778,161	11,443,112	8,284,651
8	うち、負債性有価証券の額	3,690,233	3,690,233	3,285,062	3,285,062
9	有担保資金調達等に係る資金流出額	—		702	
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	7,497,054	2,610,549	7,480,551	2,583,495
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	1,360,692	1,360,692	1,237,270	1,237,270
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	6,136,361	1,249,857	6,243,280	1,346,224
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	291,330	205,822	236,298	164,432
15	偶発事象に係る資金流出額	667,669	17,799	662,611	17,706
16	資金流出合計額	16,205,396		15,250,865	
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	192,306	—	230,742	—
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	2,678,181	1,698,798	2,526,458	1,704,190
19	その他資金流入額	472,417	394,366	554,542	438,073
20	資金流入合計額	3,342,905	2,093,165	3,311,743	2,142,263
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	19,451,554		19,347,711	
22	純資金流出額	14,112,230		13,108,601	
23	連結流動性カバレッジ比率	137.8		147.5	
24	平均値計算用データ数	60		62	