

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】

(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	19,204,229		19,077,215	
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	15,312,303	11,941,028	14,140,359	11,021,485
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	11,843,270	8,471,995	11,058,798	7,939,924
8	うち、負債性有価証券の額	3,469,033	3,469,033	3,081,560	3,081,560
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	6,536,880	2,565,062	6,526,041	2,536,808
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	1,291,282	1,291,282	1,159,723	1,159,723
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	5,245,597	1,273,779	5,366,317	1,377,085
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	300,396	214,888	243,637	171,771
15	偶発事象に係る資金流出額	676,580	18,187	670,997	18,084
16	資金流出合計額	15,641,997		14,663,665	
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	2,754,224	1,818,775	2,586,303	1,807,940
19	その他資金流入額	446,147	368,724	530,104	414,262
20	資金流入合計額	3,392,678	2,187,499	3,347,150	2,222,203
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	19,204,229		19,077,215	
22	純資金流出額	13,454,497		12,441,462	
23	単体流動性カバレッジ比率	142.7		153.3	
24	平均値計算用データ数	60		62	