

流動性カバレッジ比率に関する定量的開示事項(2024年3月期第1四半期)

【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	19,967,241		19,204,229	
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	19,027,915	908,177	19,095,882	902,830
3	うち、安定預金の額	1,782,034	53,461	1,786,650	53,599
4	うち、準安定預金の額	8,543,594	854,716	8,488,939	849,230
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	15,554,652	12,187,750	15,312,303	11,941,028
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	12,087,068	8,720,166	11,843,270	8,471,995
8	うち、負債性有価証券の額	3,467,583	3,467,583	3,469,033	3,469,033
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		2,662		—
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	6,811,020	2,646,045	6,536,880	2,565,062
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	1,274,993	1,274,993	1,291,282	1,291,282
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	5,536,026	1,371,052	5,245,597	1,273,779
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	434,234	354,195	300,396	214,888
15	偶発事象に係る資金流出額	669,016	18,049	676,580	18,187
16	資金流出合計額		16,116,880		15,641,997
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	187,013	—	192,306	—
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	2,459,519	1,667,281	2,754,224	1,818,775
19	その他資金流入額	525,168	440,826	446,147	368,724
20	資金流入合計額	3,171,701	2,108,108	3,392,678	2,187,499
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		19,967,241		19,204,229
22	純資金流出額		14,008,771		13,454,497
23	単体流動性カバレッジ比率		142.5		142.7
24	平均値計算用データ数		62		60