

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2四半期)

【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	20,631,012		20,202,105	
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	19,141,291	928,504	19,027,915	908,177
3	うち、安定預金の額	1,806,420	54,192	1,782,034	53,461
4	うち、準安定預金の額	8,739,683	874,312	8,543,594	854,716
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	15,698,732	12,078,847	16,115,595	12,697,942
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	11,966,307	8,346,422	12,408,586	8,990,934
8	うち、負債性有価証券の額	3,732,424	3,732,424	3,707,008	3,707,008
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		7,648		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	7,894,795	2,751,690	7,778,885	2,691,596
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	1,393,945	1,393,945	1,366,904	1,366,904
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	6,500,849	1,357,744	6,411,981	1,324,691
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	528,842	416,580	424,555	344,515
15	偶発事象に係る資金流出額	679,899	18,050	659,930	17,657
16	資金流出合計額		16,201,322		16,662,551
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	219,838	—	187,013	—
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	2,990,199	2,048,345	2,327,179	1,486,332
19	その他資金流入額	649,851	501,784	551,998	466,878
20	資金流入合計額	3,859,889	2,550,129	3,066,191	1,953,210
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		20,631,012		20,202,105
22	純資金流出額		13,651,192		14,709,340
23	連結流動性カバレッジ比率		151.1		137.3
24	平均値計算用データ数		62		62