

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】

(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	20,433,620		19,967,241	
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	15,208,893	11,623,096	15,554,652	12,187,750
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	11,715,389	8,129,592	12,087,068	8,720,166
8	うち、負債性有価証券の額	3,493,503	3,493,503	3,467,583	3,467,583
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	6,861,110	2,661,533	6,811,020	2,646,045
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	1,294,128	1,294,128	1,274,993	1,274,993
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	5,566,981	1,367,404	5,536,026	1,371,052
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	536,716	425,033	434,234	354,195
15	偶発事象に係る資金流出額	689,112	18,445	669,016	18,049
16	資金流出合計額		15,664,261		16,116,880
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	3,085,858	2,192,351	2,459,519	1,667,281
19	その他資金流入額	583,654	436,832	525,168	440,826
20	資金流入合計額	3,889,351	2,629,183	3,171,701	2,108,108
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		20,433,620		19,967,241
22	純資金流出額		13,035,077		14,008,771
23	単体流動性カバレッジ比率		156.7		142.5
24	平均値計算用データ数		62		62