

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3四半期)

【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 | 20,473,128 | | 20,433,620 | |
| 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 | 18,953,168 | 914,918 | 19,141,291 | 928,504 |
| 3 | うち、安定預金の額 | 1,779,508 | 53,385 | 1,806,420 | 54,192 |
| 4 | うち、準安定預金の額 | 8,611,915 | 861,533 | 8,739,683 | 874,312 |
| 5 | ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額 | 14,941,070 | 11,223,564 | 15,208,893 | 11,623,096 |
| 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 | 11,495,548 | 7,778,042 | 11,715,389 | 8,129,592 |
| 8 | うち、負債性有価証券の額 | 3,445,521 | 3,445,521 | 3,493,503 | 3,493,503 |
| 9 | 有担保資金調達等に係る資金流出額 | | 6,987 | | 7,648 |
| 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 | 7,095,031 | 2,740,118 | 6,861,110 | 2,661,533 |
| 11 | うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額 | 1,301,532 | 1,301,532 | 1,294,128 | 1,294,128 |
| 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 | 5,793,499 | 1,438,586 | 5,566,981 | 1,367,404 |
| 14 | 資金提供義務に基づく資金流出額等 | 617,174 | 492,634 | 536,716 | 425,033 |
| 15 | 偶発事象に係る資金流出額 | 692,839 | 18,524 | 689,112 | 18,445 |
| 16 | 資金流出合計額 | | 15,396,747 | | 15,664,261 |
| 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 | 246,590 | — | 219,838 | — |
| 18 | 貸付金等の回収に係る資金流入額 | 3,803,688 | 3,006,289 | 3,085,858 | 2,192,351 |
| 19 | その他資金流入額 | 529,754 | 407,426 | 583,654 | 436,832 |
| 20 | 資金流入合計額 | 4,580,034 | 3,413,715 | 3,889,351 | 2,629,183 |
| 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 | | 20,473,128 | | 20,433,620 |
| 22 | 純資金流出額 | | 11,983,032 | | 13,035,077 |
| 23 | 単体流動性カバレッジ比率 | | 170.8 | | 156.7 |
| 24 | 平均値計算用データ数 | | 62 | | 62 |