

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4四半期)

【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	21,239,739		20,722,078	
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	19,056,205	903,442	18,953,168	914,918
3	うち、安定預金の額	1,774,247	53,227	1,779,508	53,385
4	うち、準安定預金の額	8,498,717	850,215	8,611,915	861,533
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	16,251,043	12,382,634	15,520,488	11,754,093
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	11,955,943	8,087,534	11,778,730	8,012,336
8	うち、負債性有価証券の額	4,295,100	4,295,100	3,741,757	3,741,757
9	有担保資金調達等に係る資金流出額			6,987	
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	8,040,235	2,793,477	8,099,564	2,788,190
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	1,306,622	1,306,622	1,368,967	1,368,967
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	6,733,613	1,486,854	6,730,596	1,419,223
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	737,437	584,100	610,758	486,217
15	偶発事象に係る資金流出額	689,546	18,267	684,003	18,138
16	資金流出合計額	16,681,923		15,968,545	
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	204,978	—	246,590	—
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	4,600,539	3,561,103	3,784,705	2,941,926
19	その他資金流入額	787,959	609,784	555,283	432,955
20	資金流入合計額	5,593,478	4,170,888	4,586,579	3,374,882
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	21,239,739		20,722,078	
22	純資金流出額	12,511,035		12,593,663	
23	連結流動性カバレッジ比率	169.7		164.5	
24	平均値計算用データ数	58		62	