

流動性カバレッジ比率に関する定量的開示事項(2021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		13,401,434	14,166,020	
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	17,942,489	841,885	17,914,158	830,990
3	うち、安定預金の額	735,409	22,062	723,125	21,693
4	うち、準安定預金の額	8,157,797	819,823	8,052,256	809,296
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	12,433,295	10,128,872	12,707,897	10,306,870
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	10,365,961	8,061,538	10,353,766	7,952,739
8	うち、負債性有価証券の額	2,067,334	2,067,334	2,354,131	2,354,131
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		108,950		113,698
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	4,953,398	1,568,748	4,587,020	1,462,850
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	302,502	302,502	285,124	285,124
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	4,650,896	1,266,246	4,301,896	1,177,726
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	351,833	186,194	398,584	243,179
15	偶発事象に係る資金流出額	12,308,560	23,801	12,475,321	21,907
16	資金流出合計額		12,858,450		12,979,494
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	473,934	6,377	107,077	746
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	3,131,260	2,337,371	3,210,848	2,335,136
19	その他資金流入額	513,209	211,231	482,497	289,816
20	資金流入合計額	4,118,403	2,554,979	3,800,422	2,625,698
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		13,401,434		14,166,020
22	純資金流出額		10,303,471		10,353,796
23	単体流動性カバレッジ比率		130.0		136.8
24	平均値計算用データ数		61		58