

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3四半期)

【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		18,053,546	17,953,290	
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	18,077,298	854,119	18,037,241	857,095
3	うち、安定預金の額	777,642	23,329	769,901	23,097
4	うち、準安定預金の額	8,268,214	830,790	8,301,187	833,998
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	12,776,765	9,889,939	13,335,886	10,519,740
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	10,043,261	7,156,435	10,973,207	8,157,061
8	うち、負債性有価証券の額	2,733,504	2,733,504	2,362,679	2,362,679
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		47,643		56,526
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	6,291,901	1,511,812	6,372,472	1,697,577
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	308,679	308,679	338,398	338,398
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	5,983,222	1,203,133	6,034,074	1,359,179
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	337,297	206,402	337,568	216,728
15	偶発事象に係る資金流出額	11,417,464	21,935	11,359,679	22,293
16	資金流出合計額		12,531,850		13,369,959
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	222,683	—	76,808	—
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	3,245,450	2,504,022	2,977,314	2,118,404
19	その他資金流入額	561,019	232,005	389,837	249,436
20	資金流入合計額	4,029,152	2,736,027	3,443,959	2,367,840
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		18,053,546	17,953,290	
22	純資金流出額		9,795,823	11,002,119	
23	連結流動性カバレッジ比率		184.2	163.1	
24	平均値計算用データ数		63	61	