

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	18,052,471		18,053,546	
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	18,100,666	856,663	18,077,298	854,119
3	うち、安定預金の額	797,884	23,936	777,642	23,329
4	うち、準安定預金の額	8,296,160	832,727	8,268,214	830,790
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	13,364,313	10,430,071	12,776,765	9,889,939
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	10,467,313	7,533,071	10,043,261	7,156,435
8	うち、負債性有価証券の額	2,897,000	2,897,000	2,733,504	2,733,504
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		108,049		47,643
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	6,459,374	1,611,852	6,291,901	1,511,812
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	346,926	346,926	308,679	308,679
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	6,112,448	1,264,926	5,983,222	1,203,133
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	428,703	226,079	337,297	206,402
15	偶発事象に係る資金流出額	11,362,848	21,699	11,417,464	21,935
16	資金流出合計額		13,254,413		12,531,850
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	75,135	—	222,683	—
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	2,938,462	2,068,627	3,245,450	2,504,022
19	その他資金流入額	645,441	264,966	561,019	232,005
20	資金流入合計額	3,659,038	2,333,593	4,029,152	2,736,027
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		18,052,471		18,053,546
22	純資金流出額		10,920,820		9,795,823
23	連結流動性カバレッジ比率		165.3		184.2
24	平均値計算用データ数		60		63