

流動性カバレッジ比率に関する定量的開示事項(2022年3月期第2四半期)

【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		18,094,605	17,569,667	
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	18,781,567	940,105	18,748,085	920,132
3	うち、安定預金の額	835,636	25,069	807,178	24,215
4	うち、準安定預金の額	9,121,058	915,036	8,926,931	895,917
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	12,424,315	9,727,466	12,100,803	9,558,274
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	9,538,759	6,841,910	9,346,928	6,804,399
8	うち、負債性有価証券の額	2,885,556	2,885,556	2,753,875	2,753,875
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		20,280		51,422
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	6,041,350	1,633,664	6,254,423	1,676,888
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	706,951	706,951	699,104	699,104
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	5,334,399	926,713	5,555,319	977,784
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	778,381	584,748	701,332	540,301
15	偶発事象に係る資金流出額	11,160,662	22,171	11,493,274	23,356
16	資金流出合計額		12,928,434		12,770,373
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	55,788	—	49,869	—
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	3,062,169	2,243,918	2,807,960	2,078,003
19	その他資金流入額	664,724	442,437	554,136	363,621
20	資金流入合計額	3,782,681	2,686,355	3,411,965	2,441,624
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		18,094,605	17,569,667	
22	純資金流出額		10,242,079	10,328,749	
23	連結流動性カバレッジ比率		176.6	170.1	
24	平均値計算用データ数		61	61	

(注) 上記期間において、日次データを用いるべき項目の一部を月末データで代用し、算出しております。