

流動性カバレッジ比率に関する定量的開示事項(2023年3月期第1四半期)

【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	18,252,532		17,729,217	
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	19,038,291	898,598	18,934,361	885,843
3	うち、安定預金の額	1,781,123	53,433	1,774,400	53,232
4	うち、準安定預金の額	8,448,177	845,164	8,322,704	832,611
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	14,337,837	11,095,816	13,448,254	10,200,765
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	11,099,201	7,857,180	10,069,728	6,822,238
8	うち、負債性有価証券の額	3,238,635	3,238,635	3,378,526	3,378,526
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		9,209		9,960
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	6,740,218	2,162,599	6,244,437	1,832,165
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	947,818	947,818	789,784	789,784
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	5,792,400	1,214,780	5,454,652	1,042,381
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	373,622	316,645	346,296	279,924
15	偶発事象に係る資金流出額	645,330	17,386	631,953	17,114
16	資金流出合計額		14,500,254		13,225,773
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	223,239	—	246,948	—
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	2,227,657	1,478,284	2,667,575	1,845,730
19	その他資金流入額	818,440	454,677	607,529	294,099
20	資金流入合計額	3,269,337	1,932,962	3,522,053	2,139,830
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		18,252,532		17,729,217
22	純資金流出額		12,567,292		11,085,943
23	連結流動性カバレッジ比率		145.2		159.9
24	平均値計算用データ数		61		59