

流動性カバレッジ比率に関する定量的開示事項(2019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	15,231,564		16,267,668	
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	17,451,832	795,599	17,466,905	806,102
3	うち、安定預金の額	664,777	19,943	656,898	19,706
4	うち、準安定預金の額	7,714,157	775,656	7,819,808	786,395
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	13,841,910	11,263,211	13,445,180	11,223,915
6	うち、適格オペレーショナル預金の額	0	0	0	0
7	うち、適格オペレーショナル預金、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	10,969,633	8,390,934	11,054,696	8,833,431
8	うち、負債性有価証券の額	2,872,277	2,872,277	2,390,484	2,390,484
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		126,086		80,494
10	デリバティブ取引等、資金調達プログラム、与信・流動性 ファシリティに係る資金流出額	5,506,037	1,634,864	5,477,877	1,690,799
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	410,164	410,164	482,590	482,590
12	うち、資金調達プログラムに係る資金流出額	0	0	0	0
13	うち、与信・流動性ファシリティに係る資金流出額	5,095,873	1,224,700	4,995,287	1,208,209
14	資金提供義務等に基づく資金流出額	640,539	510,656	502,099	390,275
15	偶発事象に係る資金流出額	10,782,290	22,941	10,727,789	22,982
16	資金流出合計額		14,353,357		14,214,567
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	92,345	0	80,566	0
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	3,003,573	2,097,780	2,836,914	2,074,610
19	その他資金流入額	345,927	190,839	327,996	175,355
20	資金流入合計額	3,441,845	2,288,619	3,245,476	2,249,965
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		15,231,564		16,267,668
22	純資金流出額		12,064,738		11,964,602
23	連結流動性カバレッジ比率		126.2		135.9
24	平均値計算用データ数		58		62

(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。