

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】

(単体・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	15,076,420		16,072,242	
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	17,452,016	795,638	17,467,067	806,134
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	7,714,341	775,695	7,819,970	786,427
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	13,642,463	11,017,141	13,175,360	10,911,648
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	10,884,210	8,258,888	10,916,623	8,652,911
8	うち、負債性有価証券の額	2,758,253	2,758,253	2,258,737	2,258,737
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	4,889,119	1,609,242	4,870,482	1,665,637
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	410,155	410,155	482,582	482,582
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	4,478,964	1,199,087	4,387,900	1,183,055
14	資金提供義務等に基づく資金流出額	321,895	191,999	298,524	186,691
15	偶発事象に係る資金流出額	12,488,971	23,035	12,437,556	23,109
16	資金流出合計額		13,763,141		13,673,713
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	3,360,023	2,473,611	3,170,606	2,432,716
19	その他資金流入額	377,590	222,502	359,092	206,451
20	資金流入合計額	3,829,958	2,696,113	3,610,264	2,639,167
単体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		15,076,420		16,072,242
22	純資金流出額		11,067,028		11,034,546
23	単体流動性カバレッジ比率		136.2		145.6
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。