

流動性カバレッジ比率に関する定量的開示事項(2020年3月期第1四半期)

【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	15,100,550		15,076,420	
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	17,505,609	816,088	17,452,016	795,638
3	うち、安定預金の額	675,158	20,254	664,777	19,943
4	うち、準安定預金の額	7,915,957	795,833	7,714,341	775,695
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	13,356,073	11,201,311	13,642,463	11,017,141
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	10,883,484	8,728,722	10,884,210	8,258,888
8	うち、負債性有価証券の額	2,472,589	2,472,589	2,758,253	2,758,253
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		114,991		126,086
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	4,883,352	1,562,536	4,889,119	1,609,242
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	315,657	315,657	410,155	410,155
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	4,567,695	1,246,879	4,478,964	1,199,087
14	資金提供義務等に基づく資金流出額	312,805	205,822	321,895	191,999
15	偶発事象に係る資金流出額	12,718,359	24,910	12,488,971	23,035
16	資金流出合計額		13,925,658		13,763,141
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	81,355	0	92,345	0
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	2,983,480	2,314,467	3,360,023	2,473,611
19	その他資金流入額	311,039	222,835	377,590	222,502
20	資金流入合計額	3,375,874	2,537,302	3,829,958	2,696,113
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		15,100,550		15,076,420
22	純資金流出額		11,388,356		11,067,028
23	単体流動性カバレッジ比率		132.5		136.2
24	平均値計算用データ数		59		58

(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。