

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)

【三井住友トラスト・ホールディングス】

(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	15,297,151		15,231,564	
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	17,505,449	816,053	17,451,832	795,599
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	7,915,797	795,798	7,714,157	775,656
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	13,536,000	11,410,062	13,722,633	11,144,377
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	10,995,528	8,869,590	10,950,615	8,372,359
8	うち、負債性有価証券の額	2,540,472	2,540,472	2,772,018	2,772,018
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	5,522,638	1,610,815	5,506,037	1,634,864
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	337,896	337,896	410,164	410,164
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	5,184,742	1,272,919	5,095,873	1,224,700
14	資金提供義務等に基づく資金流出額	606,273	499,246	645,834	515,951
15	偶発事象に係る資金流出額	11,122,717	24,752	10,782,290	22,941
16	資金流出合計額		14,475,919		14,239,818
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	2,483,701	1,792,644	3,003,573	2,097,780
19	その他資金流入額	302,244	212,685	345,927	190,839
20	資金流入合計額	2,867,300	2,005,329	3,441,845	2,288,619
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		15,297,151		15,231,564
22	純資金流出額		12,470,590		11,951,199
23	連結流動性カバレッジ比率		122.6		127.4
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。