

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2四半期)

【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		15,446,412	15,297,151	
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	17,597,966	821,685	17,505,449	816,053
3	うち、安定預金の額	695,051	20,851	675,158	20,254
4	うち、準安定預金の額	7,967,809	800,833	7,915,797	795,798
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	13,266,820	10,763,501	13,638,724	11,512,497
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	10,654,242	8,150,923	11,025,981	8,899,754
8	うち、負債性有価証券の額	2,612,578	2,612,578	2,612,743	2,612,743
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		188,060		114,991
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	5,397,274	1,619,341	5,522,638	1,610,815
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	370,861	370,861	337,896	337,896
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	5,026,413	1,248,480	5,184,742	1,272,919
14	資金提供義務等に基づく資金流出額	441,855	318,688	586,048	479,021
15	偶発事象に係る資金流出額	11,155,410	24,258	11,122,717	24,752
16	資金流出合計額		13,735,533		14,558,129
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	69,457	0	81,355	0
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	2,669,521	1,862,841	2,483,701	1,792,644
19	その他資金流入額	455,235	288,532	302,244	212,685
20	資金流入合計額	3,194,213	2,151,373	2,867,300	2,005,329
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		15,446,412	15,297,151	
22	純資金流出額		11,584,160	12,552,800	
23	連結流動性カバレッジ比率		133.3	121.8	
24	平均値計算用データ数		62	59	

(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。