

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3四半期)

【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		15,025,280	15,251,414	
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	17,686,868	829,405	17,598,051	821,710
3	うち、安定預金の額	705,619	21,168	695,051	20,851
4	うち、準安定預金の額	8,041,083	808,236	7,967,894	800,859
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	12,613,857	10,739,838	13,048,448	10,524,442
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	10,323,056	8,449,037	10,556,654	8,032,648
8	うち、負債性有価証券の額	2,290,801	2,290,801	2,491,794	2,491,794
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		141,480		188,060
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	4,672,528	1,447,662	4,698,736	1,547,515
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	231,978	231,978	328,575	328,575
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	4,440,550	1,215,684	4,370,161	1,218,940
14	資金提供義務等に基づく資金流出額	315,455	204,713	357,062	233,949
15	偶発事象に係る資金流出額	12,702,678	23,998	12,710,688	24,321
16	資金流出合計額		13,387,096		13,339,997
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	55,582	0	69,457	0
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	2,754,165	2,148,551	3,034,097	2,278,670
19	その他資金流入額	396,262	240,936	437,720	277,969
20	資金流入合計額	3,206,009	2,389,487	3,541,274	2,556,639
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		15,025,280	15,251,414	
22	純資金流出額		10,997,609	10,783,358	
23	単体流動性カバレッジ比率		136.6	141.4	
24	平均値計算用データ数		62	62	

(注) 前四半期において、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。