

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】

(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	15,251,414		15,100,550	
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	17,598,051	821,710	17,505,609	816,088
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	7,967,894	800,859	7,915,957	795,833
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	13,048,448	10,524,442	13,356,073	11,201,311
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	10,556,654	8,032,648	10,883,484	8,728,722
8	うち、負債性有価証券の額	2,491,794	2,491,794	2,472,589	2,472,589
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	4,698,736	1,547,515	4,883,352	1,562,536
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	328,575	328,575	315,657	315,657
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	4,370,161	1,218,940	4,567,695	1,246,879
14	資金提供義務等に基づく資金流出額	357,062	233,949	312,805	205,822
15	偶発事象に係る資金流出額	12,710,688	24,321	12,718,359	24,910
16	資金流出合計額	13,339,997		13,925,658	
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	3,034,097	2,278,670	2,983,480	2,314,467
19	その他資金流入額	437,720	277,969	311,039	222,835
20	資金流入合計額	3,541,274	2,556,639	3,375,874	2,537,302
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	15,251,414		15,100,550	
22	純資金流出額	10,783,358		11,388,356	
23	単体流動性カバレッジ比率	141.4		132.5	
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。