

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】

(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	15,227,585		15,446,412	
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	17,686,799	829,384	17,597,966	821,685
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	8,041,014	808,216	7,967,809	800,833
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	12,881,330	11,006,610	13,266,820	10,763,501
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	10,469,634	8,594,914	10,654,242	8,150,923
8	うち、負債性有価証券の額	2,411,696	2,411,696	2,612,578	2,612,578
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	5,409,251	1,517,919	5,397,274	1,619,341
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	269,806	269,806	370,861	370,861
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	5,139,445	1,248,113	5,026,413	1,248,480
14	資金提供義務等に基づく資金流出額	426,116	315,311	441,855	318,688
15	偶発事象に係る資金流出額	11,146,969	23,935	11,155,410	24,258
16	資金流出合計額	13,834,639		13,735,533	
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	2,337,861	1,617,876	2,669,521	1,862,841
19	その他資金流入額	403,693	247,058	455,235	288,532
20	資金流入合計額	2,797,136	1,864,934	3,194,213	2,151,373
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	15,227,585		15,446,412	
22	純資金流出額	11,969,705		11,584,160	
23	連結流動性カバレッジ比率	127.2		133.3	
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。