

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4四半期)

【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	14,412,361		15,227,585	
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	17,914,127	830,981	17,686,799	829,384
3	うち、安定預金の額	723,125	21,693	705,619	21,168
4	うち、準安定預金の額	8,052,225	809,287	8,041,014	808,216
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	12,984,336	10,581,603	12,881,330	11,006,610
6	うち、適格オペレーショナル預金の額	—	—	0	0
7	うち、適格オペレーショナル預金及び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	10,501,879	8,099,146	10,469,634	8,594,914
8	うち、負債性有価証券の額	2,482,457	2,482,457	2,411,696	2,411,696
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		113,698		141,480
10	デリバティブ取引等、資金調達プログラム及び与信・流動性ファシリティに係る資金流出額	5,388,536	1,546,383	5,409,251	1,517,919
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	333,644	333,644	269,806	269,806
12	うち、資金調達プログラムに係る資金流出額	—	—	0	0
13	うち、与信・流動性ファシリティに係る資金流出額	5,054,892	1,212,739	5,139,445	1,248,113
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	505,285	349,791	426,116	315,311
15	偶発事象に係る資金流出額	10,947,809	21,830	11,146,969	23,935
16	資金流出合計額		13,444,286		13,834,639
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	107,077	746	55,582	0
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	2,790,920	1,857,979	2,337,861	1,617,876
19	その他資金流入額	504,121	307,459	403,693	247,058
20	資金流入合計額	3,402,118	2,166,184	2,797,136	1,864,934
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		14,412,361		15,227,585
22	純資金流出額		11,278,102		11,969,705
23	連結流動性カバレッジ比率		127.7		127.2
24	平均値計算用データ数		58		62