

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】

(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	14,166,020		15,025,280	
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	17,914,158	830,990	17,686,868	829,405
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	8,052,256	809,296	8,041,083	808,236
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	12,707,897	10,306,870	12,613,857	10,739,838
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	10,353,766	7,952,739	10,323,056	8,449,037
8	うち、負債性有価証券の額	2,354,131	2,354,131	2,290,801	2,290,801
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	4,587,020	1,462,850	4,672,528	1,447,662
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	285,124	285,124	231,978	231,978
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	4,301,896	1,177,726	4,440,550	1,215,684
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	398,584	243,179	315,455	204,713
15	偶発事象に係る資金流出額	12,475,321	21,907	12,702,678	23,998
16	資金流出合計額	12,979,494		13,387,096	
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	3,210,848	2,335,136	2,754,165	2,148,551
19	その他資金流入額	482,497	289,816	396,262	240,936
20	資金流入合計額	3,800,422	2,625,698	3,206,009	2,389,487
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	14,166,020		15,025,280	
22	純資金流出額	10,353,796		10,997,609	
23	単体流動性カバレッジ比率	136.8		136.6	
24	平均値計算用データ数	58		62	