

流動性カバレッジ比率に関する定量的開示事項(平成29年3月期第1四半期)

【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	11,816,837		12,879,371	
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	16,647,906	654,702	16,668,450	624,006
3	うち、安定預金の額	527,657	15,829	512,082	15,362
4	うち、準安定預金の額	6,242,446	638,873	5,963,303	608,644
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	12,846,537	8,857,052	14,374,347	10,512,169
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	10,046,265	6,056,780	10,412,769	6,550,591
8	うち、負債性有価証券の額	2,800,272	2,800,272	3,961,578	3,961,578
9	有担保資金調達等に係る資金流出額			0	13,462
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	4,807,196	1,379,188	4,807,810	1,477,137
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	662,855	662,855	759,954	759,954
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	4,144,341	716,333	4,047,856	717,183
14	資金提供義務等に基づく資金流出額	595,649	344,500	710,901	415,886
15	偶発事象に係る資金流出額	11,091,678	29,200	10,869,629	28,011
16	資金流出合計額			11,264,642	13,070,671
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	6,559	6,559	446,198	446,198
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	4,923,369	3,542,427	4,669,929	3,301,146
19	その他資金流入額	631,894	476,388	859,443	645,154
20	資金流入合計額	5,561,822	4,025,374	5,975,570	4,392,498
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	11,816,837		12,879,371	
22	純資金流出額	7,239,268		8,678,173	
23	単体流動性カバレッジ比率	163.3		151.7	
24	平均値計算用データ数	3		3	