

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2四半期)

【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	11,775,455		11,931,829	
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	16,744,466	628,066	16,647,707	654,654
3	うち、安定預金の額	524,716	15,741	527,657	15,829
4	うち、準安定預金の額	5,949,863	612,325	6,242,247	638,825
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	13,481,262	9,191,535	12,896,254	8,948,787
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	10,781,564	6,491,837	10,051,115	6,103,648
8	うち、負債性有価証券の額	2,699,698	2,699,698	2,845,139	2,845,139
9	有担保資金調達等に係る資金流出額				
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	5,340,641	1,421,660	5,100,464	1,388,533
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	621,562	621,562	662,860	662,860
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	4,719,079	800,098	4,437,604	725,673
14	資金提供義務等に基づく資金流出額	734,361	415,728	661,954	410,797
15	偶発事象に係る資金流出額	10,613,381	25,558	9,976,193	28,766
16	資金流出合計額	11,682,547		11,431,537	
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	17,488	16,175	6,559	6,559
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	4,086,669	2,690,667	4,704,001	3,312,100
19	その他資金流入額	619,741	510,247	600,781	444,896
20	資金流入合計額	4,723,898	3,217,089	5,311,341	3,763,555
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	11,775,455		11,931,829	
22	純資金流出額	8,465,458		7,667,982	
23	連結流動性カバレッジ比率	139.4		155.9	
24	平均値計算用データ数	3		3	