

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)

【三井住友トラスト・ホールディングス】

(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 | 21,700,200 | | 22,106,394 | |
| 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 | 23,380,415 | 18,514,498 | 23,819,260 | 19,170,148 |
| 6 | うち、適格オペレーショナル預金の額 | 768,653 | 192,163 | 936,194 | 234,048 |
| 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 | 19,922,664 | 15,633,237 | 20,007,727 | 16,060,761 |
| 8 | うち、負債性有価証券の額 | 2,689,098 | 2,689,098 | 2,875,339 | 2,875,339 |
| 9 | 有担保資金調達等に係る資金流出額 | | 0 | | 0 |
| 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 | 5,353,775 | 1,422,973 | 5,268,549 | 1,397,645 |
| 11 | うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額 | 621,562 | 621,562 | 662,863 | 662,863 |
| 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 | 4,732,213 | 801,411 | 4,605,686 | 734,782 |
| 14 | 資金提供義務等に基づく資金流出額 | 720,239 | 401,601 | 638,806 | 387,648 |
| 15 | 偶発事象に係る資金流出額 | 10,613,381 | 25,558 | 9,981,788 | 28,878 |
| 16 | 資金流出合計額 | | 20,992,696 | | 21,638,973 |
| 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 | 4,302,053 | 2,821,391 | 4,844,653 | 3,439,443 |
| 19 | その他資金流入額 | 601,400 | 486,921 | 580,969 | 418,246 |
| 20 | 資金流入合計額 | 4,920,941 | 3,324,487 | 5,432,181 | 3,864,248 |
| 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 | | 21,700,200 | | 22,106,394 |
| 22 | 純資金流出額 | | 17,668,209 | | 17,774,725 |
| 23 | 連結流動性カバレッジ比率 | | 122.8 | | 124.3 |
| 24 | 平均値計算用データ数 | | 3 | | 3 |