

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3四半期)

【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	10,772,076		11,775,455	
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	16,767,272	652,670	16,744,466	628,066
3	うち、安定預金の額	555,117	16,653	524,716	15,741
4	うち、準安定預金の額	6,167,601	636,017	5,949,863	612,325
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	12,893,058	8,200,852	13,481,262	9,191,535
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	10,829,706	6,137,500	10,781,564	6,491,837
8	うち、負債性有価証券の額	2,063,352	2,063,352	2,699,698	2,699,698
9	有担保資金調達等に係る資金流出額			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	5,497,551	1,590,360	5,340,641	1,421,660
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	775,060	775,060	621,562	621,562
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	4,722,491	815,300	4,719,079	800,098
14	資金提供義務等に基づく資金流出額	712,417	409,100	734,361	415,728
15	偶発事象に係る資金流出額	10,524,912	23,661	10,613,381	25,558
16	資金流出合計額	10,876,643		11,682,547	
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	24,459	24,459	17,488	16,175
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	4,484,416	2,892,551	4,086,669	2,690,667
19	その他資金流入額	574,837	501,764	619,741	510,247
20	資金流入合計額	5,083,712	3,418,774	4,723,898	3,217,089
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	10,772,076		11,775,455	
22	純資金流出額	7,457,869		8,465,458	
23	連結流動性カバレッジ比率	145.5		139.4	
24	平均値計算用データ数	3		3	