

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】

(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	10,605,836		11,610,013	
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	16,767,413	652,699	16,744,583	628,088
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	6,167,742	636,046	5,949,980	612,347
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	12,609,124	7,878,602	13,283,305	8,957,335
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	10,683,705	5,953,183	10,680,274	6,354,304
8	うち、負債性有価証券の額	1,925,419	1,925,419	2,603,031	2,603,031
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	5,066,781	1,574,121	4,902,209	1,405,022
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	775,034	775,034	621,542	621,542
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	4,291,747	799,087	4,280,667	783,480
14	資金提供義務等に基づく資金流出額	613,652	310,477	633,924	315,298
15	偶発事象に係る資金流出額	11,919,901	23,682	11,997,396	25,578
16	資金流出合計額	10,439,581		11,331,321	
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	4,750,305	3,183,173	4,345,396	2,967,040
19	その他資金流入額	606,790	534,218	652,414	543,567
20	資金流入合計額	5,381,554	3,741,850	5,015,298	3,526,782
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	10,605,836		11,610,013	
22	純資金流出額	6,697,731		7,804,539	
23	単体流動性カバレッジ比率	159.8		149.1	
24	平均値計算用データ数	3		3	