

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4四半期)

【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	11,914,002		10,772,076	
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	17,702,805	724,078	16,767,272	652,670
3	うち、安定預金の額	562,023	16,860	555,117	16,653
4	うち、準安定預金の額	7,035,487	707,217	6,167,601	636,017
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	10,354,685	6,948,129	12,893,058	8,200,852
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	8,259,857	4,853,301	10,829,706	6,137,500
8	うち、負債性有価証券の額	2,094,828	2,094,828	2,063,352	2,063,352
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		66,484		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	5,287,003	1,442,370	5,497,551	1,590,360
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	606,870	606,870	775,060	775,060
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	4,680,133	835,500	4,722,491	815,300
14	資金提供義務等に基づく資金流出額	450,999	297,064	712,417	409,100
15	偶発事象に係る資金流出額	10,296,764	23,048	10,524,912	23,661
16	資金流出合計額		9,501,173		10,876,643
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	43,545	40,943	24,459	24,459
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	4,683,513	2,882,805	4,484,416	2,892,551
19	その他資金流入額	337,809	281,656	574,837	501,764
20	資金流入合計額	5,064,867	3,205,404	5,083,712	3,418,774
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		11,914,002		10,772,076
22	純資金流出額		6,295,769		7,457,869
23	連結流動性カバレッジ比率		189.2		145.5
24	平均値計算用データ数		61		3