

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】

(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	11,750,054		10,605,836	
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	17,702,930	724,103	16,767,413	652,699
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	7,035,612	707,243	6,167,742	636,046
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	10,142,849	6,705,635	12,609,124	7,878,602
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	8,159,475	4,722,261	10,683,705	5,953,183
8	うち、負債性有価証券の額	1,983,374	1,983,374	1,925,419	1,925,419
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	4,851,138	1,425,863	5,066,781	1,574,121
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	606,855	606,855	775,034	775,034
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	4,244,283	819,008	4,291,747	799,087
14	資金提供義務等に基づく資金流出額	356,122	202,184	613,652	310,477
15	偶発事象に係る資金流出額	12,054,166	23,093	11,919,901	23,682
16	資金流出合計額		9,147,362		10,439,581
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	5,007,097	3,225,000	4,750,305	3,183,173
19	その他資金流入額	374,418	318,265	606,790	534,218
20	資金流入合計額	5,425,060	3,584,208	5,381,554	3,741,850
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		11,750,054		10,605,836
22	純資金流出額		5,563,154		6,697,731
23	単体流動性カバレッジ比率		211.2		159.8
24	平均値計算用データ数		61		3