

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1四半期)

【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	11,931,829		13,077,553	
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	16,647,707	654,654	16,668,154	623,933
3	うち、安定預金の額	527,657	15,829	512,082	15,362
4	うち、準安定預金の額	6,242,247	638,825	5,963,007	608,571
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	12,896,254	8,948,787	14,609,979	10,794,273
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	10,051,115	6,103,648	10,588,424	6,772,718
8	うち、負債性有価証券の額	2,845,139	2,845,139	4,021,555	4,021,555
9	有担保資金調達等に係る資金流出額			13,462	
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	5,100,464	1,388,533	5,255,112	1,494,208
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	662,860	662,860	759,967	759,967
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	4,437,604	725,673	4,495,145	734,241
14	資金提供義務等に基づく資金流出額	661,954	410,797	774,151	479,125
15	偶発事象に係る資金流出額	9,976,193	28,766	9,680,636	27,622
16	資金流出合計額	11,431,537		13,432,623	
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	6,559	6,559	446,198	446,198
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	4,704,001	3,312,100	4,478,178	3,086,067
19	その他資金流入額	600,781	444,896	826,005	611,290
20	資金流入合計額	5,311,341	3,763,555	5,750,381	4,143,555
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	11,931,829		13,077,553	
22	純資金流出額	7,667,982		9,289,068	
23	連結流動性カバレッジ比率	155.9		143.4	
24	平均値計算用データ数	3		3	