

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)

【三井住友トラスト・ホールディングス】

(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	22,106,394		17,685,348	
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	23,819,260	19,170,148	19,598,752	14,727,743
6	うち、適格オペレーショナル預金の額	936,194	234,048	1,407,475	351,868
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	20,007,727	16,060,761	14,169,722	10,354,320
8	うち、負債性有価証券の額	2,875,339	2,875,339	4,021,555	4,021,555
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		0		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	5,268,549	1,397,645	5,268,912	1,495,588
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	662,863	662,863	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	4,605,686	734,782	4,508,945	735,621
14	資金提供義務等に基づく資金流出額	638,806	387,648	777,794	482,748
15	偶発事象に係る資金流出額	9,981,788	28,878	9,680,636	27,622
16	資金流出合計額		21,638,973		17,371,096
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	4,844,653	3,439,443	4,605,849	3,213,738
19	その他資金流入額	580,969	418,246	829,690	611,309
20	資金流入合計額	5,432,181	3,864,248	5,881,737	4,271,245
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		22,106,394		17,685,348
22	純資金流出額		17,774,725		13,099,851
23	連結流動性カバレッジ比率		124.3		139.9
24	平均値計算用データ数		3		3