

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2四半期)

【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	11,610,013		11,816,837	
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	16,744,583	628,088	16,647,906	654,702
3	うち、安定預金の額	524,716	15,741	527,657	15,829
4	うち、準安定預金の額	5,949,980	612,347	6,242,446	638,873
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	13,283,305	8,957,335	12,846,537	8,857,052
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	10,680,274	6,354,304	10,046,265	6,056,780
8	うち、負債性有価証券の額	2,603,031	2,603,031	2,800,272	2,800,272
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	4,902,209	1,405,022	4,807,196	1,379,188
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	621,542	621,542	662,855	662,855
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	4,280,667	783,480	4,144,341	716,333
14	資金提供義務等に基づく資金流出額	633,924	315,298	595,649	344,500
15	偶発事象に係る資金流出額	11,997,396	25,578	11,091,678	29,200
16	資金流出合計額	11,331,321		11,264,642	
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	17,488	16,175	6,559	6,559
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	4,345,396	2,967,040	4,923,369	3,542,427
19	その他資金流入額	652,414	543,567	631,894	476,388
20	資金流入合計額	5,015,298	3,526,782	5,561,822	4,025,374
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	11,610,013		11,816,837	
22	純資金流出額	7,804,539		7,239,268	
23	単体流動性カバレッジ比率	149.1		163.3	
24	平均値計算用データ数	3		3	