

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	21,700,200		22,106,394	
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	16,744,466	628,066	16,647,707	654,654
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	5,949,863	612,325	6,242,247	638,825
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	23,380,415	18,514,498	23,819,260	19,170,148
6	うち、適格オペレーショナル預金の額	768,653	192,163	936,194	234,048
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	19,922,664	15,633,237	20,007,727	16,060,761
8	うち、負債性有価証券の額	2,689,098	2,689,098	2,875,339	2,875,339
9	有担保資金調達等に係る資金流出額	0		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	5,353,775	1,422,973	5,268,549	1,397,645
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	621,562	621,562	662,863	662,863
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	4,732,213	801,411	4,605,686	734,782
14	資金提供義務等に基づく資金流出額	720,239	401,601	638,806	387,648
15	偶発事象に係る資金流出額	10,613,381	25,558	9,981,788	28,878
16	資金流出合計額	20,992,696		21,638,973	
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	4,302,053	2,821,391	4,844,653	3,439,443
19	その他資金流入額	601,400	486,921	580,969	418,246
20	資金流入合計額	4,920,941	3,324,487	5,432,181	3,864,248
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	21,700,200		22,106,394	
22	純資金流出額	17,668,209		17,774,725	
23	連結流動性カバレッジ比率	122.8		124.3	
24	平均値計算用データ数	3		3	