

流動性カバレッジ比率に関する定量的開示事項(2018年3月期第4四半期)

【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	15,286,840		15,101,090	
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	17,557,173	779,425	17,606,209	788,616
3	うち、安定預金の額	623,200	18,696	613,121	18,393
4	うち、準安定預金の額	7,567,290	760,729	7,663,915	770,223
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	12,295,501	8,482,353	11,834,835	8,192,349
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	10,281,931	6,468,783	9,532,881	5,890,395
8	うち、負債性有価証券の額	2,013,570	2,013,570	2,301,954	2,301,954
9	有担保資金調達等に係る資金流出額	39,491		41,760	
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	5,293,376	1,294,669	5,412,830	1,348,552
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	516,681	516,681	556,746	556,746
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	4,776,695	777,988	4,856,084	791,806
14	資金提供義務等に基づく資金流出額	554,421	344,052	466,497	309,072
15	偶発事象に係る資金流出額	10,530,663	22,863	10,423,011	23,027
16	資金流出合計額	10,962,853		10,703,376	
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	15,596	12,972	83,491	78,865
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	4,700,474	2,965,021	4,521,634	2,814,343
19	その他資金流入額	384,867	283,519	325,832	229,039
20	資金流入合計額	5,100,937	3,261,512	4,930,957	3,122,247
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	15,286,840		15,101,090	
22	純資金流出額	7,701,341		7,581,129	
23	連結流動性カバレッジ比率	198.4		199.1	
24	平均値計算用データ数	59		62	