

流動性カバレッジ比率に関する定量的開示事項(平成30年3月期第3四半期)

【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	14,929,778		14,009,355	
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	17,606,344	788,640	17,741,736	782,659
3	うち、安定預金の額	613,121	18,393	602,070	18,062
4	うち、準安定預金の額	7,664,050	770,246	7,611,497	764,597
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	11,529,767	7,856,640	10,877,173	7,348,128
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	9,378,265	5,705,138	8,629,580	5,100,535
8	うち、負債性有価証券の額	2,151,502	2,151,502	2,247,593	2,247,593
9	有担保資金調達等に係る資金流出額	41,760		61,099	
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	4,845,111	1,325,461	4,749,978	1,333,442
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	556,733	556,733	560,444	560,444
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	4,288,378	768,728	4,189,534	772,998
14	資金提供義務等に基づく資金流出額	351,549	194,119	387,728	175,220
15	偶発事象に係る資金流出額	12,167,267	23,057	11,928,522	23,057
16	資金流出合計額	10,229,677		9,723,605	
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	83,491	78,865	71,358	65,531
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	4,836,846	3,155,325	4,878,994	3,171,849
19	その他資金流入額	357,626	260,833	356,554	286,955
20	資金流入合計額	5,277,963	3,495,023	5,306,906	3,524,335
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	14,929,778		14,009,355	
22	純資金流出額	6,734,654		6,199,270	
23	単体流動性カバレッジ比率	221.6		225.9	
24	平均値計算用データ数	62		62	