

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】

(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	15,114,946		14,929,778	
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	17,557,278	779,441	17,606,344	788,640
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	7,567,395	760,745	7,664,050	770,246
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	12,030,902	8,182,023	11,529,767	7,856,640
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	10,148,934	6,300,055	9,378,265	5,705,138
8	うち、負債性有価証券の額	1,881,968	1,881,968	2,151,502	2,151,502
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	4,713,940	1,271,144	4,845,111	1,325,461
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	516,671	516,671	556,733	556,733
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	4,197,269	754,473	4,288,378	768,728
14	資金提供義務等に基づく資金流出額	440,797	230,419	351,549	194,119
15	偶発事象に係る資金流出額	12,285,249	22,870	12,167,267	23,057
16	資金流出合計額	10,525,388		10,229,677	
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	5,064,782	3,355,584	4,836,846	3,155,325
19	その他資金流入額	415,061	313,713	357,626	260,833
20	資金流入合計額	5,495,439	3,682,269	5,277,963	3,495,023
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	15,114,946		14,929,778	
22	純資金流出額	6,843,119		6,734,654	
23	単体流動性カバレッジ比率	220.8		221.6	
24	平均値計算用データ数	59		62	