

流動性カバレッジ比率に関する定量的開示事項(平成28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	11,183,485		9,661,025	
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	16,748,440	652,813	16,536,365	666,751
3	うち、安定預金の額	506,460	15,193	510,157	15,304
4	うち、準安定預金の額	6,257,516	637,619	6,394,760	651,446
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	10,631,396	6,621,033	9,521,989	6,330,918
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	7,774,244	3,763,881	6,320,295	3,129,224
8	うち、負債性有価証券の額	2,857,151	2,857,151	3,201,694	3,201,694
9	有担保資金調達等に係る資金流出額	878,178		261,678	
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	4,894,276	1,735,799	4,966,916	1,837,129
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	1,072,935	1,072,935	1,127,414	1,127,414
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	3,821,341	662,864	3,839,501	709,715
14	資金提供義務等に基づく資金流出額	1,085,449	567,764	708,305	482,297
15	偶発事象に係る資金流出額	10,639,398	28,508	10,714,591	9,467
16	資金流出合計額	10,484,097		9,588,243	
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	3,167	3,167	7,554	7,554
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	4,810,490	3,310,529	4,597,123	3,159,557
19	その他資金流入額	898,414	833,787	891,411	829,216
20	資金流入合計額	5,712,071	4,147,483	5,496,089	3,996,328
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	11,183,485		9,661,025	
22	純資金流出額	6,336,613		5,591,914	
23	単体流動性カバレッジ比率	177.6		174.9	
24	平均値計算用データ数	3		3	