

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3四半期)

【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	12,049,455		11,321,566	
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	16,697,838	651,882	16,748,044	652,727
3	うち、安定預金の額	519,123	15,573	506,460	15,193
4	うち、準安定預金の額	6,243,644	636,309	6,257,121	637,533
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	11,651,565	7,804,898	10,924,317	6,944,228
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	7,913,295	4,066,628	7,962,298	3,982,210
8	うち、負債性有価証券の額	3,738,270	3,738,270	2,962,018	2,962,018
9	有担保資金調達等に係る資金流出額			1,023,835	878,178
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	5,386,660	1,687,998	5,378,344	1,754,753
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	971,374	971,374	1,072,951	1,072,951
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	4,415,286	716,624	4,305,393	681,802
14	資金提供義務等に基づく資金流出額	823,856	510,209	1,131,547	613,861
15	偶発事象に係る資金流出額	9,537,198	28,053	9,329,126	28,342
16	資金流出合計額	11,706,875		10,872,092	
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	3,156	3,156	3,167	3,167
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	4,636,991	3,072,286	4,747,246	3,228,740
19	その他資金流入額	699,551	644,623	899,929	835,002
20	資金流入合計額	5,339,698	3,720,065	5,650,342	4,066,909
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	12,049,455		11,321,566	
22	純資金流出額	7,986,810		6,805,183	
23	連結流動性カバレッジ比率	150.9		167.7	
24	平均値計算用データ数	3		3	