

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】

(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	11,904,217		11,183,485	
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	16,698,245	651,989	16,748,440	652,813
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	6,244,051	636,416	6,257,516	637,619
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	11,374,988	7,489,434	10,631,396	6,621,033
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	7,743,384	3,857,830	7,774,244	3,763,881
8	うち、負債性有価証券の額	3,631,604	3,631,604	2,857,151	2,857,151
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	4,939,669	1,670,939	4,894,276	1,735,799
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	971,358	971,358	1,072,935	1,072,935
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	3,968,311	699,581	3,821,341	662,864
14	資金提供義務等に基づく資金流出額	779,223	465,591	1,085,449	567,764
15	偶発事象に係る資金流出額	10,753,785	28,597	10,639,398	28,508
16	資金流出合計額	11,330,385		10,484,097	
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	4,833,277	3,289,311	4,810,490	3,310,529
19	その他資金流入額	710,204	655,838	898,414	833,787
20	資金流入合計額	5,546,637	3,948,305	5,712,071	4,147,483
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	11,904,217		11,183,485	
22	純資金流出額	7,382,080		6,336,613	
23	単体流動性カバレッジ比率	161.3		177.6	
24	平均値計算用データ数	3		3	