

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】

(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	11,321,566		9,784,665	
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	16,748,044	652,727	16,535,992	666,652
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	6,257,121	637,533	6,394,387	651,347
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	10,924,317	6,944,228	9,788,975	6,628,748
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	7,962,298	3,982,210	6,484,107	3,323,879
8	うち、負債性有価証券の額	2,962,018	2,962,018	3,304,868	3,304,868
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	5,378,344	1,754,753	5,455,409	1,856,321
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	1,072,951	1,072,951	1,127,430	1,127,430
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	4,305,393	681,802	4,327,979	728,890
14	資金提供義務等に基づく資金流出額	1,131,547	613,861	767,736	541,727
15	偶発事象に係る資金流出額	9,329,126	28,342	9,379,578	9,578
16	資金流出合計額		10,872,092		9,964,707
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	4,747,246	3,228,740	4,563,353	3,106,305
19	その他資金流入額	899,929	835,002	892,220	829,859
20	資金流入合計額	5,650,342	4,066,909	5,463,128	3,943,718
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		11,321,566		9,784,665
22	純資金流出額		6,805,183		6,020,988
23	連結流動性カバレッジ比率		167.7		164.1
24	平均値計算用データ数		3		3