

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)

【三井住友トラスト・ホールディングス】

(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	17,685,348		13,902,589	
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	16,668,154	623,933	16,697,838	651,882
3	うち、安定預金の額	512,082	15,362	519,123	15,573
4	うち、準安定預金の額	5,963,007	608,571	6,243,644	636,309
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	19,598,752	14,727,743	13,441,245	8,851,257
6	うち、適格オペレーショナル預金の額	1,407,475	351,868	991,287	247,821
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	14,169,722	10,354,320	8,711,688	4,865,166
8	うち、負債性有価証券の額	4,021,555	4,021,555	3,738,270	3,738,270
9	有担保資金調達等に係る資金流出額	13,462		1,023,835	
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	5,268,912	1,495,588	5,400,360	1,689,368
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	759,967	759,967	971,374	971,374
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	4,508,945	735,621	4,428,986	717,994
14	資金提供義務等に基づく資金流出額	777,794	482,748	803,970	490,270
15	偶発事象に係る資金流出額	9,680,636	27,622	9,536,532	28,053
16	資金流出合計額	17,371,096		12,734,665	
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	446,198	446,198	3,156	3,156
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	4,605,849	3,213,738	4,776,690	3,211,985
19	その他資金流入額	829,690	611,309	689,410	621,314
20	資金流入合計額	5,881,737	4,271,245	5,469,256	3,836,455
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	17,685,348		13,902,589	
22	純資金流出額	13,099,851		8,898,210	
23	連結流動性カバレッジ比率	139.9		156.3	
24	平均値計算用データ数	3		3	