

**「連結流動性カバレッジ比率に関する定量的開示事項」**

<みずほ信託銀行>  
平成28年3月期第2四半期

(単位：百万円、%、件)

項目		当四半期		前四半期	
<b>適格流動資産 (1)</b>					
1	適格流動資産の合計額	2,178,200		2,162,593	
<b>資金流出額 (2)</b>					
		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	1,777,292	165,101	1,773,747	165,489
3	うち、安定預金の額	180,416	5,412	169,823	5,094
4	うち、準安定預金の額	1,596,876	159,689	1,603,923	160,394
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,864,845	1,499,191	1,917,834	1,511,902
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及び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	1,721,988	1,356,335	1,793,141	1,387,209
8	うち、負債性有価証券の額	142,856	142,856	124,693	124,693
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		0		0
10	デリバティブ取引等、資金調達プログラム及び与信・流動性ファシリティに係る資金流出額	466,532	111,339	460,376	108,662
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	7,240	7,240	14,141	14,141
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	459,291	104,098	446,235	94,520
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	15,768	13,534	33,900	19,281
15	偶発事象に係る資金流出額	995,619	2,239	991,631	2,262
16	資金流出合計額		1,791,406		1,807,597
<b>資金流入額 (3)</b>					
		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	0	0	0	0
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	264,024	215,463	283,229	228,526
19	その他資金流入額	249,767	23,878	175,071	17,208
20	資金流入合計額	513,791	239,341	458,301	245,734
<b>連結流動性カバレッジ比率 (4)</b>					
21	算入可能適格流動資産の合計額		2,178,200		2,162,593
22	純資金流出額		1,552,064		1,561,863
23	連結流動性カバレッジ比率		140.5%		139.3%
24	平均値計算用データ数	3		3	