

「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3四半期

(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 | 2,181,745 | | 2,178,200 | |
| 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 | 1,750,703 | 161,684 | 1,777,292 | 165,101 |
| 3 | うち、安定預金の額 | 191,248 | 5,737 | 180,416 | 5,412 |
| 4 | うち、準安定預金の額 | 1,559,455 | 155,947 | 1,596,876 | 159,689 |
| 5 | ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額 | 1,971,946 | 1,575,593 | 1,864,845 | 1,499,191 |
| 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 | 1,835,356 | 1,439,003 | 1,721,988 | 1,356,335 |
| 8 | うち、負債性有価証券の額 | 136,590 | 136,590 | 142,856 | 142,856 |
| 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 | 478,914 | 126,268 | 466,532 | 111,339 |
| 11 | うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額 | 6,878 | 6,878 | 7,240 | 7,240 |
| 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 | 472,035 | 119,390 | 459,291 | 104,098 |
| 14 | 資金提供義務に基づく資金流出額等 | 63,425 | 21,910 | 15,768 | 13,534 |
| 15 | 偶発事象に係る資金流出額 | 1,007,272 | 2,308 | 995,619 | 2,239 |
| 16 | 資金流出合計額 | | 1,887,767 | | 1,791,406 |
| 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 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 18 | 貸付金等の回収に係る資金流入額 | 296,304 | 238,101 | 264,024 | 215,463 |
| 19 | その他資金流入額 | 171,226 | 19,458 | 249,767 | 23,878 |
| 20 | 資金流入合計額 | 467,530 | 257,559 | 513,791 | 239,341 |
| 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 | | 2,181,745 | | 2,178,200 |
| 22 | 純資金流出額 | | 1,630,207 | | 1,552,064 |
| 23 | 連結流動性カバレッジ比率 | | 133.8% | | 140.5% |
| 24 | 平均値計算用データ数 | 3 | | 3 | |