

**「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4四半期

(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	2,238,087		2,181,745	
<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	1,757,095	161,765	1,750,703	161,684
3	うち、安定預金の額	199,231	5,976	191,248	5,737
4	うち、準安定預金の額	1,557,864	155,788	1,559,455	155,947
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	2,242,546	1,808,640	1,971,946	1,575,593
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	2,075,039	1,641,133	1,835,356	1,439,003
8	うち、負債性有価証券の額	167,506	167,506	136,590	136,590
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	457,093	119,143	478,914	126,268
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	13,591	13,591	6,878	6,878
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	443,502	105,552	472,035	119,390
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	57,762	9,725	63,425	21,910
15	偶発事象に係る資金流出額	1,015,662	2,229	1,007,272	2,308
16	資金流出合計額		2,101,503		1,887,767
<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	33,878	0	0	0
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	327,777	242,118	296,304	238,101
19	その他資金流入額	120,387	17,213	171,226	19,458
20	資金流入合計額	482,042	259,331	467,530	257,559
<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		2,238,087		2,181,745
22	純資金流出額		1,842,172		1,630,207
23	連結流動性カバレッジ比率		121.8%		133.8%
24	平均値計算用データ数	3		3	