

**「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29年3月期第1四半期

(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	2,164,935		2,238,087	
<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	1,741,127	159,876	1,757,095	161,765
3	うち、安定預金の額	203,398	6,101	199,231	5,976
4	うち、準安定預金の額	1,537,729	153,774	1,557,864	155,788
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	2,090,850	1,606,992	2,242,546	1,808,640
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	1,977,627	1,493,769	2,075,039	1,641,133
8	うち、負債性有価証券の額	113,223	113,223	167,506	167,506
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	479,729	122,045	457,093	119,143
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	17,983	17,983	13,591	13,591
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	461,745	104,061	443,502	105,552
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	96,737	18,413	57,762	9,725
15	偶発事象に係る資金流出額	1,019,955	2,152	1,015,662	2,229
16	資金流出合計額		1,909,480		2,101,503
<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	29,059	0	33,878	0
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	323,832	247,609	327,777	242,118
19	その他資金流入額	40,153	8,455	120,387	17,213
20	資金流入合計額	393,044	256,064	482,042	259,331
<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		2,164,935		2,238,087
22	純資金流出額		1,653,415		1,842,172
23	連結流動性カバレッジ比率		131.4%		121.8%
24	平均値計算用データ数	3		3	