

「単体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＞
2023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 | |
|-------------------------|---|--------------|--------------|--------------|--------------|
| 適格流動資産 (1) | | | | | |
| 1 | 適格流動資産の合計額 | 1,936,912 | | 1,792,449 | |
| 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 | 1,569,193 | 138,613 | 1,598,069 | 141,388 |
| 3 | うち、安定預金の額 | 263,215 | 7,896 | 264,792 | 7,943 |
| 4 | うち、準安定預金の額 | 1,305,977 | 130,716 | 1,333,277 | 133,444 |
| 5 | ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額 | 1,490,820 | 1,211,839 | 1,383,251 | 1,100,842 |
| 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 | 1,341,688 | 1,062,706 | 1,177,605 | 895,196 |
| 8 | うち、負債性有価証券の額 | 149,132 | 149,132 | 205,645 | 205,645 |
| 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 | 436,829 | 98,601 | 429,681 | 93,005 |
| 11 | うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額 | 18,874 | 18,874 | 18,755 | 18,755 |
| 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 | 417,954 | 79,726 | 410,926 | 74,250 |
| 14 | 資金提供義務に基づく資金流出額等 | 17,812 | 17,784 | 2,528 | 1,805 |
| 15 | 偶発事象に係る資金流出額 | 1,020,092 | 1,612 | 1,006,707 | 1,575 |
| 16 | 資金流出合計額 | | 1,468,450 | | 1,338,616 |
| 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 | 40,508 | 0 | 6,802 | 0 |
| 18 | 貸付金等の回収に係る資金流入額 | 187,695 | 129,371 | 202,747 | 132,529 |
| 19 | その他資金流入額 | 12,928 | 12,894 | 12,045 | 11,826 |
| 20 | 資金流入合計額 | 241,132 | 142,266 | 221,596 | 144,356 |
| 単体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 | | 1,936,912 | | 1,792,449 |
| 22 | 純資金流出額 | | 1,326,184 | | 1,194,260 |
| 23 | 単体流動性カバレッジ比率 | | 147.5% | | 152.5% |
| 24 | 平均値計算用データ数 | 61 | | 59 | |