

**「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＞  
2024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                                      | 2,835,989    |              | 2,629,418    |              |
| <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                             | 1,533,522    | 135,354      | 1,556,584    | 137,457      |
| 3                       | うち、安定預金の額                                       | 258,432      | 7,752        | 261,425      | 7,842        |
| 4                       | うち、準安定預金の額                                      | 1,275,089    | 127,601      | 1,295,159    | 129,615      |
| 5                       | ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額                           | 1,980,534    | 1,663,791    | 2,199,607    | 1,928,320    |
| 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 | 1,922,359    | 1,605,615    | 2,113,364    | 1,842,078    |
| 8                       | うち、負債性有価証券の額                                    | 58,175       | 58,175       | 86,242       | 86,242       |
| 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       | 409,639      | 94,455       | 437,509      | 104,696      |
| 11                      | うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額                            | 20,037       | 20,037       | 19,386       | 19,386       |
| 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                         | 389,602      | 74,418       | 418,123      | 85,310       |
| 14                      | 資金提供義務に基づく資金流出額等                                | 12,679       | 10,236       | 1,849        | 1,828        |
| 15                      | 偶発事象に係る資金流出額                                    | 1,009,410    | 1,635        | 992,887      | 1,585        |
| 16                      | 資金流出合計額   |              | 1,905,473    |              | 2,173,889    |
| <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                                | 90,101       | 0            | 2,003        | 0            |
| 18                      | 貸付金等の回収に係る資金流入額                                 | 189,361      | 127,669      | 235,969      | 150,066      |
| 19                      | その他資金流入額  | 19,070       | 18,968       | 3,578        | 3,521        |
| 20                      | 資金流入合計額   | 298,533      | 146,638      | 241,551      | 153,587      |
| <b>単体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                                  |              | 2,835,989    |              | 2,629,418    |
| 22                      | 純資金流出額  |              | 1,758,834    |              | 2,020,301    |
| 23                      | 単体流動性カバレッジ比率                                    |              | 162.2%       |              | 130.3%       |
| 24                      | 平均値計算用データ数                                      | 62           |              | 60           |              |