

「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>
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	2,121,119		2,130,183	
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	1,815,335	1,418,399	1,701,990	1,335,786
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	1,677,945	1,281,009	1,558,267	1,192,062
8	うち、負債性有価証券の額	137,390	137,390	143,723	143,723
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	478,889	126,243	466,449	111,256
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	6,853	6,853	7,158	7,158
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	55,231	13,716	9,020	6,786
15	偶発事象に係る資金流出額	1,015,697	2,561	1,005,867	2,547
16	資金流出合計額		1,722,606		1,621,478
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	218,787	160,586	176,813	128,360
19	その他資金流入額	168,901	22,496	246,004	22,592
20	資金流入合計額	387,688	183,083	422,817	150,952
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		2,121,119		2,130,183
22	純資金流出額		1,539,522		1,470,525
23	単体流動性カバレッジ比率		137.7%		145.0%
24	平均値計算用データ数	3		3	