

「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 | |
|-------------------------|---|--------------|--------------|--------------|--------------|
| 適格流動資産 (1) | | | | | |
| 1 | 適格流動資産の合計額 | 49,805,539 | | 47,838,667 | |
| 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 | 42,214,013 | 3,370,664 | 42,057,839 | 3,365,009 |
| 3 | うち、安定預金の額 | 12,188,565 | 365,656 | 12,048,321 | 361,449 |
| 4 | うち、準安定預金の額 | 30,025,448 | 3,005,007 | 30,009,517 | 3,003,559 |
| 5 | ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額 | 54,796,018 | 30,888,043 | 53,839,976 | 32,173,937 |
| 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 | 50,187,495 | 26,279,519 | 46,526,898 | 24,860,859 |
| 8 | うち、負債性有価証券の額 | 4,608,523 | 4,608,523 | 7,313,078 | 7,313,078 |
| 9 | 有担保資金調達等に係る資金流出額 | | 61,816 | | 343,947 |
| 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 | 23,029,341 | 6,033,529 | 24,048,504 | 6,290,272 |
| 11 | うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額 | 1,835,666 | 1,835,666 | 1,831,004 | 1,831,004 |
| 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 | 21,193,675 | 4,197,863 | 22,217,499 | 4,459,268 |
| 14 | 資金提供義務に基づく資金流出額等 | 1,142,640 | 704,406 | 2,067,777 | 564,218 |
| 15 | 偶発事象に係る資金流出額 | 67,840,746 | 625,154 | 68,072,404 | 631,843 |
| 16 | 資金流出合計額 | | 41,683,616 | | 43,369,228 |
| 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 | 661,515 | 62,110 | 589,882 | 139,412 |
| 18 | 貸付金等の回収に係る資金流入額 | 7,374,176 | 5,090,804 | 8,472,198 | 5,885,611 |
| 19 | その他資金流入額 | 2,645,451 | 1,743,192 | 2,259,068 | 1,255,563 |
| 20 | 資金流入合計額 | 10,681,144 | 6,896,108 | 11,321,148 | 7,280,587 |
| 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 | | 49,805,539 | | 47,838,667 |
| 22 | 純資金流出額 | | 34,787,507 | | 36,088,641 |
| 23 | 単体流動性カバレッジ比率 | | 143.2% | | 132.7% |
| 24 | 平均値計算用データ数 | 3 | | 3 | |