

「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	2,110,644		2,189,068	
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	1,741,127	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	1,953,075	1,469,217	2,108,495	1,674,589
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	1,838,519	1,354,661	1,940,122	1,506,216
8	うち、負債性有価証券の額	114,556	114,556	168,373	168,373
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	479,524	121,840	457,021	119,071
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	17,778	17,778	13,519	13,519
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	86,503	8,178	49,752	1,715
15	偶発事象に係る資金流出額	1,028,633	2,412	1,022,547	2,436
16	資金流出合計額		1,761,525		1,959,577
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	29,059	0	33,878	0
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	235,184	158,962	254,533	168,874
19	その他資金流入額	49,541	17,843	128,559	27,126
20	資金流入合計額	313,785	176,805	416,970	196,001
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		2,110,644		2,189,068
22	純資金流出額		1,584,720		1,763,576
23	単体流動性カバレッジ比率		133.9%		124.3%
24	平均値計算用データ数	3		3	