

**「連結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2四半期

(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	2,195,752		2,164,935	
<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	1,744,684	159,960	1,741,127	159,876
3	うち、安定預金の額	207,280	6,218	203,398	6,101
4	うち、準安定預金の額	1,537,404	153,742	1,537,729	153,774
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,938,568	1,534,816	2,090,850	1,606,992
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	1,816,608	1,412,856	1,977,627	1,493,769
8	うち、負債性有価証券の額	121,960	121,960	113,223	113,223
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	462,032	119,141	479,729	122,045
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	18,348	18,348	17,983	17,983
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	443,683	100,793	461,745	104,061
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	31,924	13,821	96,737	18,413
15	偶発事象に係る資金流出額	1,028,296	2,157	1,019,955	2,152
16	資金流出合計額		1,829,898		1,909,480
<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	69,189	0	29,059	0
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	258,806	198,078	323,832	247,609
19	その他資金流入額	25,867	8,228	40,153	8,455
20	資金流入合計額	353,863	206,307	393,044	256,064
<b>連結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		2,195,752		2,164,935
22	純資金流出額		1,623,591		1,653,415
23	連結流動性カバレッジ比率		135.6%		131.4%
24	平均値計算用データ数	3		3	