

「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2四半期

(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	2,177,024		2,110,644	
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	1,744,684	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	1,880,536	1,476,784	1,953,075	1,469,217
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	1,757,376	1,353,624	1,838,519	1,354,661
8	うち、負債性有価証券の額	123,160	123,160	114,556	114,556
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	461,993	119,102	479,524	121,840
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	18,309	18,309	17,778	17,778
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	24,688	6,586	86,503	8,178
15	偶発事象に係る資金流出額	1,037,444	2,432	1,028,633	2,412
16	資金流出合計額		1,764,865		1,761,525
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	69,189	0	29,059	0
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	193,628	132,901	235,184	158,962
19	その他資金流入額	35,860	18,221	49,541	17,843
20	資金流入合計額	298,678	151,123	313,785	176,805
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		2,177,024		2,110,644
22	純資金流出額		1,613,742		1,584,720
23	単体流動性カバレッジ比率		135.2%		133.9%
24	平均値計算用データ数	3		3	