

「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 | 2,155,640 | | 2,177,024 | |
| 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 | 1,740,683 | 159,250 | 1,744,684 | 159,960 |
| 3 | うち、安定預金の額 | 211,709 | 6,351 | 207,280 | 6,218 |
| 4 | うち、準安定預金の額 | 1,528,974 | 152,899 | 1,537,404 | 153,742 |
| 5 | ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額 | 1,823,003 | 1,392,206 | 1,880,536 | 1,476,784 |
| 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 | 1,708,346 | 1,277,550 | 1,757,376 | 1,353,624 |
| 8 | うち、負債性有価証券の額 | 114,656 | 114,656 | 123,160 | 123,160 |
| 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 | 471,487 | 119,332 | 461,993 | 119,102 |
| 11 | うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額 | 17,121 | 17,121 | 18,309 | 18,309 |
| 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 | 454,366 | 102,210 | 443,683 | 100,793 |
| 14 | 資金提供義務に基づく資金流出額等 | 13,718 | 9,662 | 24,688 | 6,586 |
| 15 | 偶発事象に係る資金流出額 | 1,015,581 | 2,331 | 1,037,444 | 2,432 |
| 16 | 資金流出合計額 | | 1,682,783 | | 1,764,865 |
| 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 | 36,678 | 0 | 69,189 | 0 |
| 18 | 貸付金等の回収に係る資金流入額 | 193,354 | 136,668 | 193,628 | 132,901 |
| 19 | その他資金流入額 | 87,095 | 21,890 | 35,860 | 18,221 |
| 20 | 資金流入合計額 | 317,129 | 158,558 | 298,678 | 151,123 |
| 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 | | 2,155,640 | | 2,177,024 |
| 22 | 純資金流出額 | | 1,524,224 | | 1,613,742 |
| 23 | 単体流動性カバレッジ比率 | | 141.6% | | 135.2% |
| 24 | 平均値計算用データ数 | 3 | | 3 | |