

「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4四半期

(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	2,432,148		2,173,648	
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	1,737,480	158,631	1,740,683	159,250
3	うち、安定預金の額	215,979	6,479	211,709	6,351
4	うち、準安定預金の額	1,521,501	152,151	1,528,974	152,899
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	2,318,484	1,814,699	1,881,489	1,450,693
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	2,213,219	1,709,434	1,767,832	1,337,036
8	うち、負債性有価証券の額	105,264	105,264	113,656	113,656
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	467,259	121,670	471,510	119,354
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	19,158	19,158	17,144	17,144
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	448,100	102,512	454,366	102,210
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	25,990	13,637	22,305	18,249
15	偶発事象に係る資金流出額	1,002,458	2,110	1,007,309	2,083
16	資金流出合計額		2,110,748		1,749,631
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	118,145	0	36,678	0
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	367,935	274,203	269,035	212,348
19	その他資金流入額	29,949	8,657	78,906	11,888
20	資金流入合計額	516,031	282,860	384,620	224,236
連結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		2,432,148		2,173,648
22	純資金流出額		1,827,888		1,525,394
23	連結流動性カバレッジ比率		133.5%		142.7%
24	平均値計算用データ数	61		3	