

「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	2,410,080		2,155,640	
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	2,246,237	1,742,452	1,823,003	1,392,206
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	2,140,972	1,637,187	1,708,346	1,277,550
8	うち、負債性有価証券の額	105,264	105,264	114,656	114,656
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	467,182	121,593	471,487	119,332
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	19,081	19,081	17,121	17,121
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	18,269	5,916	13,718	9,662
15	偶発事象に係る資金流出額	1,012,184	2,402	1,015,581	2,331
16	資金流出合計額		2,030,995		1,682,783
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	289,960	196,228	193,354	136,668
19	その他資金流入額	39,304	18,448	87,095	21,890
20	資金流入合計額	447,411	214,676	317,129	158,558
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		2,410,080		2,155,640
22	純資金流出額		1,816,318		1,524,224
23	単体流動性カバレッジ比率		133.0%		141.6%
24	平均値計算用データ数	61		3	