

**「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30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         |              |
|-------------------------|---|--------------|--------------|--------------|--------------|
| <b>適格流動資産 (1)</b>       |   |              |              |              |              |
| 1                       | 適格流動資産の合計額                                      | 2,538,558    |              | 2,535,391    |              |
| <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                             | 1,809,631    | 164,947      | 1,733,464    | 157,620      |
| 3                       | うち、安定預金の額                                       | 230,832      | 6,924        | 226,815      | 6,804        |
| 4                       | うち、準安定預金の額                                      | 1,578,798    | 158,022      | 1,506,648    | 150,815      |
| 5                       | ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額                           | 1,960,267    | 1,589,801    | 1,916,139    | 1,647,232    |
| 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 | 1,853,325    | 1,482,858    | 1,820,946    | 1,552,039    |
| 8                       | うち、負債性有価証券の額                                    | 106,942      | 106,942      | 95,192       | 95,192       |
| 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       | 403,928      | 93,109       | 424,465      | 105,418      |
| 11                      | うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額                            | 19,825       | 19,825       | 19,860       | 19,860       |
| 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                         | 384,102      | 73,284       | 404,604      | 85,558       |
| 14                      | 資金提供義務に基づく資金流出額等                                | 25,952       | 17,829       | 24,056       | 19,904       |
| 15                      | 偶発事象に係る資金流出額                                    | 1,008,609    | 2,035        | 1,027,957    | 2,056        |
| 16                      | 資金流出合計額   |              | 1,867,724    |              | 1,932,232    |
| <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                                | 88,452       | 0            | 97,014       | 0            |
| 18                      | 貸付金等の回収に係る資金流入額                                 | 331,962      | 254,510      | 339,673      | 262,596      |
| 19                      | その他資金流入額  | 40,324       | 11,616       | 30,478       | 17,738       |
| 20                      | 資金流入合計額   | 460,740      | 266,126      | 467,166      | 280,334      |
| <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                                  |              | 2,538,558    |              | 2,535,391    |
| 22                      | 純資金流出額  |              | 1,601,597    |              | 1,651,897    |
| 23                      | 連結流動性カバレッジ比率                                    |              | 160.3%       |              | 154.6%       |
| 24                      | 平均値計算用データ数                                      | 59           |              | 62           |              |