

「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>
2020年3月期第1四半期

(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	2,730,195		2,674,793	
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	1,725,697	155,052	1,751,472	158,174
3	うち、安定預金の額	252,148	7,564	244,379	7,331
4	うち、準安定預金の額	1,473,548	147,488	1,507,092	150,843
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,858,555	1,549,245	2,041,693	1,653,873
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	1,698,049	1,388,740	1,934,972	1,547,152
8	うち、負債性有価証券の額	160,505	160,505	106,720	106,720
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	418,564	92,887	377,295	78,493
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	10,925	10,925	11,834	11,834
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	407,638	81,962	365,461	66,659
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	92,303	20,021	54,633	11,346
15	偶発事象に係る資金流出額	972,556	2,060	942,170	1,985
16	資金流出合計額		1,819,267		1,903,874
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	138,112	0	151,244	0
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	243,568	166,931	316,930	226,723
19	その他資金流入額	101,278	10,449	108,873	14,142
20	資金流入合計額	482,960	177,381	577,048	240,866
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		2,730,195		2,674,793
22	純資金流出額		1,641,886		1,663,007
23	連結流動性カバレッジ比率		168.4%		162.4%
24	平均値計算用データ数	59		58	