

「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2四半期

(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	2,748,930		2,730,195	
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	1,720,069	154,479	1,725,697	155,052
3	うち、安定預金の額	252,254	7,567	252,148	7,564
4	うち、準安定預金の額	1,467,815	146,911	1,473,548	147,488
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,828,136	1,504,439	1,858,555	1,549,245
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	1,721,341	1,397,644	1,698,049	1,388,740
8	うち、負債性有価証券の額	106,794	106,794	160,505	160,505
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	384,354	81,777	418,564	92,887
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	10,754	10,754	10,925	10,925
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	373,600	71,023	407,638	81,962
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	77,410	21,814	92,303	20,021
15	偶発事象に係る資金流出額	982,365	2,050	972,556	2,060
16	資金流出合計額		1,764,560		1,819,267
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	151,053	0	138,112	0
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	200,184	134,412	243,568	166,931
19	その他資金流入額	134,929	6,308	101,278	10,449
20	資金流入合計額	486,166	140,721	482,960	177,381
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		2,748,930		2,730,195
22	純資金流出額		1,623,839		1,641,886
23	連結流動性カバレッジ比率		171.9%		168.4%
24	平均値計算用データ数		62		59