

「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3四半期

(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	2,656,653		2,748,930	
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	1,704,190	152,718	1,720,069	154,479
3	うち、安定預金の額	254,797	7,643	252,254	7,567
4	うち、準安定預金の額	1,449,393	145,074	1,467,815	146,911
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,761,879	1,478,150	1,828,136	1,504,439
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	1,635,987	1,352,258	1,721,341	1,397,644
8	うち、負債性有価証券の額	125,891	125,891	106,794	106,794
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	415,529	94,925	384,354	81,777
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	18,364	18,364	10,754	10,754
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	397,165	76,561	373,600	71,023
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	68,567	45,845	77,410	21,814
15	偶発事象に係る資金流出額	999,444	1,957	982,365	2,050
16	資金流出合計額		1,773,597		1,764,560
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	98,524	0	151,053	0
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	185,144	127,185	200,184	134,412
19	その他資金流入額	93,490	7,518	134,929	6,308
20	資金流入合計額	377,158	134,704	486,166	140,721
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		2,656,653		2,748,930
22	純資金流出額		1,638,893		1,623,839
23	連結流動性カバレッジ比率		163.0%		171.9%
24	平均値計算用データ数	62		62	