

「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＞
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	2,606,634		2,687,519	
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	1,685,340	1,401,610	1,735,739	1,412,041
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	1,559,448	1,275,718	1,628,944	1,305,247
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	10,753	10,753
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	59,693	36,971	68,450	12,855
15	偶発事象に係る資金流出額	1,015,144	2,428	998,065	2,521
16	資金流出合計額		1,688,655		1,663,674
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	175,405	117,447	190,090	124,318
19	その他資金流入額	94,778	16,537	137,564	15,609
20	資金流入合計額	368,708	133,985	478,708	139,928
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		2,606,634		2,687,519
22	純資金流出額		1,554,670		1,523,746
23	単体流動性カバレッジ比率		168.7%		179.5%
24	平均値計算用データ数	62		62	