

「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4四半期

(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	2,546,160		2,656,653	
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	1,713,701	153,523	1,704,190	152,718
3	うち、安定預金の額	256,925	7,707	254,797	7,643
4	うち、準安定預金の額	1,456,775	145,815	1,449,393	145,074
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,933,889	1,614,415	1,761,879	1,478,150
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	1,739,992	1,420,518	1,635,987	1,352,258
8	うち、負債性有価証券の額	193,897	193,897	125,891	125,891
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	407,544	96,066	415,529	94,925
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	22,063	22,063	18,364	18,364
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	385,481	74,002	397,165	76,561
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	97,207	18,611	68,567	45,845
15	偶発事象に係る資金流出額	974,045	1,751	999,444	1,957
16	資金流出合計額		1,884,367		1,773,597
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	72,265	0	98,524	0
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	267,460	183,077	185,144	127,185
19	その他資金流入額	89,259	10,196	93,490	7,518
20	資金流入合計額	428,985	193,273	377,158	134,704
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		2,546,160		2,656,653
22	純資金流出額		1,691,094		1,638,893
23	連結流動性カバレッジ比率		151.2%		163.0%
24	平均値計算用データ数	58		62	