

「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	2,489,140		2,606,634	
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	1,850,790	1,531,316	1,685,340	1,401,610
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	1,656,892	1,337,418	1,559,448	1,275,718
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	96,065	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	88,000	9,404	59,693	36,971
15	偶発事象に係る資金流出額	989,745	2,222	1,015,144	2,428
16	資金流出合計額		1,792,532		1,688,655
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	258,077	173,694	175,405	117,447
19	その他資金流入額	93,332	19,714	94,778	16,537
20	資金流入合計額	423,674	193,408	368,708	133,985
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		2,489,140		2,606,634
22	純資金流出額		1,599,123		1,554,670
23	単体流動性カバレッジ比率		156.2%		168.7%
24	平均値計算用データ数	58		62	