

**「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＞  
2021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	
<b>適格流動資産 (1)</b>					
1	適格流動資産の合計額	2,251,836		2,225,423	
<b>資金流出額 (2)</b>		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	1,666,995	148,658	1,679,560	149,949
3	うち、安定預金の額	259,664	7,789	259,169	7,775
4	うち、準安定預金の額	1,407,331	140,868	1,420,391	142,174
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	2,008,551	1,663,141	1,886,094	1,620,304
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	1,869,746	1,524,336	1,739,165	1,473,375
8	うち、負債性有価証券の額	138,805	138,805	146,929	146,929
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		3,351		31
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	442,541	101,639	426,454	103,790
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	20,571	20,571	25,061	25,061
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	421,969	81,067	401,392	78,728
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	106,787	21,227	91,674	29,228
15	偶発事象に係る資金流出額	1,009,395	1,729	977,302	1,731
16	資金流出合計額		1,939,746		1,905,035
<b>資金流入額 (3)</b>		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	5,014	0	68,005	0
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	255,602	179,772	240,106	168,227
19	その他資金流入額	186,744	28,637	121,802	14,095
20	資金流入合計額	447,361	208,409	429,913	182,322
<b>連結流動性カバレッジ比率 (4)</b>					
21	算入可能適格流動資産の合計額		2,251,836		2,225,423
22	純資金流出額		1,731,336		1,722,712
23	連結流動性カバレッジ比率		129.9%		129.3%
24	平均値計算用データ数	61		61	