

**「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3四半期

(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	2,086,778		2,251,836	
<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	1,644,503	146,268	1,666,995	148,658
3	うち、安定預金の額	261,643	7,849	259,664	7,789
4	うち、準安定預金の額	1,382,860	138,419	1,407,331	140,868
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,530,165	1,235,585	2,008,551	1,663,141
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	1,406,380	1,111,800	1,869,746	1,524,336
8	うち、負債性有価証券の額	123,784	123,784	138,805	138,805
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		0		3,351
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	429,641	96,044	442,541	101,639
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	19,106	19,106	20,571	20,571
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	410,534	76,937	421,969	81,067
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	10,931	10,845	106,787	21,227
15	偶発事象に係る資金流出額	1,018,005	1,715	1,009,395	1,729
16	資金流出合計額		1,490,458		1,939,746
<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	28,827	0	5,014	0
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	250,802	170,880	255,602	179,772
19	その他資金流入額	60,957	6,423	186,744	28,637
20	資金流入合計額	340,586	177,303	447,361	208,409
<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		2,086,778		2,251,836
22	純資金流出額		1,313,155		1,731,336
23	連結流動性カバレッジ比率		160.0%		129.9%
24	平均値計算用データ数	63		61	