

「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＞
2022年3月期第1四半期

(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 | 2,067,541 | | 1,901,617 | |
| 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 | 1,605,735 | 142,040 | 1,639,029 | 145,523 |
| 3 | うち、安定預金の額 | 266,686 | 8,000 | 264,443 | 7,933 |
| 4 | うち、準安定預金の額 | 1,339,048 | 134,039 | 1,374,585 | 137,589 |
| 5 | ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額 | 1,499,734 | 1,216,717 | 1,522,448 | 1,181,554 |
| 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 | 1,380,626 | 1,097,610 | 1,364,912 | 1,024,018 |
| 8 | うち、負債性有価証券の額 | 119,107 | 119,107 | 157,536 | 157,536 |
| 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 | 442,002 | 96,959 | 437,104 | 96,419 |
| 11 | うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額 | 19,820 | 19,820 | 19,318 | 19,318 |
| 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 | 422,181 | 77,139 | 417,786 | 77,101 |
| 14 | 資金提供義務に基づく資金流出額等 | 10,004 | 9,136 | 4,512 | 3,277 |
| 15 | 偶発事象に係る資金流出額 | 1,024,839 | 1,709 | 1,037,664 | 1,820 |
| 16 | 資金流出合計額 | | 1,466,564 | | 1,428,595 |
| 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 | 8,139 | 0 | 8,646 | 0 |
| 18 | 貸付金等の回収に係る資金流入額 | 203,645 | 140,793 | 221,920 | 145,042 |
| 19 | その他資金流入額 | 24,406 | 21,593 | 17,736 | 16,668 |
| 20 | 資金流入合計額 | 236,191 | 162,387 | 248,303 | 161,711 |
| 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 | | 2,067,541 | | 1,901,617 |
| 22 | 純資金流出額 | | 1,304,176 | | 1,266,884 |
| 23 | 単体流動性カバレッジ比率 | | 159.5% | | 151.0% |
| 24 | 平均値計算用データ数 | 61 | | 60 | |