

「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＞
2022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 | |
|-------------------------|---|--------------|--------------|--------------|--------------|
| 適格流動資産 (1) | | | | | |
| 1 | 適格流動資産の合計額 | 2,072,436 | | 2,138,327 | |
| 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 | 1,607,986 | 142,376 | 1,605,735 | 142,040 |
| 3 | うち、安定預金の額 | 265,017 | 7,950 | 266,686 | 8,000 |
| 4 | うち、準安定預金の額 | 1,342,969 | 134,425 | 1,339,048 | 134,039 |
| 5 | ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額 | 1,581,488 | 1,283,099 | 1,625,240 | 1,342,224 |
| 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 | 1,454,311 | 1,155,921 | 1,506,133 | 1,223,116 |
| 8 | うち、負債性有価証券の額 | 127,177 | 127,177 | 119,107 | 119,107 |
| 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 | 439,672 | 98,897 | 442,002 | 96,960 |
| 11 | うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額 | 19,385 | 19,385 | 19,820 | 19,820 |
| 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 | 420,287 | 79,511 | 422,181 | 77,139 |
| 14 | 資金提供義務に基づく資金流出額等 | 6,977 | 6,587 | 15,590 | 14,722 |
| 15 | 偶発事象に係る資金流出額 | 1,019,337 | 1,667 | 1,023,639 | 1,673 |
| 16 | 資金流出合計額 | | 1,532,627 | | 1,597,620 |
| 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 | 329 | 0 | 8,139 | 0 |
| 18 | 貸付金等の回収に係る資金流入額 | 207,147 | 138,369 | 221,931 | 159,080 |
| 19 | その他資金流入額 | 17,638 | 2,789 | 16,934 | 12,249 |
| 20 | 資金流入合計額 | 225,114 | 141,158 | 247,006 | 171,329 |
| 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 | | 2,072,436 | | 2,138,327 |
| 22 | 純資金流出額 | | 1,391,469 | | 1,426,291 |
| 23 | 連結流動性カバレッジ比率 | | 149.5% | | 150.5% |
| 24 | 平均値計算用データ数 | 61 | | 61 | |