

「連結レバレッジ比率の構成に関する事項」

くみずほ信託銀行
平成27年9月末

(単位：百万円、%)

国際様式 (表2)の該 当番号	国際様式 (表1)の該 当番号	項目	平成27年9月末	平成26年9月末
オン・バランス資産の額 (1)				
1		調整項目控除前のオン・バランス資産の額	6,984,143	
1a	1	連結貸借対照表における総資産の額	7,122,208	
1b	2	連結レバレッジ比率の範囲に含まれない子法人等の資産の額 (△)	-	
1c	7	連結レバレッジ比率の範囲に含まれる子会社の資産の額 (連結貸借対照表における総資産の額に含まれる額を除く。)	-	
1d	3	連結貸借対照表における総資産の額から控除される調整項目以外の資産の額 (△)	138,064	
2	7	Tier1資本に係る調整項目の額 (△)	24,596	
3		オン・バランス資産の額 (イ)	6,959,547	
デリバティブ取引等に関する額 (2)				
4		デリバティブ取引等に関する再構築コストの額	16,664	
5		デリバティブ取引等に関するアドオンの額	34,261	
		デリバティブ取引等に関連して現金で差し入れた証拠金の対価の額	20,015	
6		連結貸借対照表から控除されているデリバティブ取引等に関連して現金で差し入れた証拠金の対価の額	-	
7		デリバティブ取引等に関連して現金で差し入れた変動証拠金の対価の額のうち控除する額 (△)	-	
8		清算会員である銀行が補償を義務付けられていない顧客とのトレード・エクスポージャーの額 (△)		
9		クレジット・デリバティブのプロテクションを提供した場合における調整後想定元本の額	-	
10		クレジット・デリバティブのプロテクションを提供した場合における調整後想定元本の額から控除した額 (△)	-	
11	4	デリバティブ取引等に関する額 (ロ)	70,941	
レポ取引等に関する額 (3)				
12		レポ取引等に関する資産の額	-	
13		レポ取引等に関する資産の額から控除した額 (△)	-	
14		レポ取引等に関するカウンターパーティ・リスクのエクスポージャーの額	7,940	
15		代理取引のエクスポージャーの額		
16	5	レポ取引等に関する額 (ハ)	7,940	
オフ・バランス取引に関する額 (4)				
17		オフ・バランス取引の想定元本の額	634,451	
18		オフ・バランス取引に係るエクスポージャーの額への変換調整の額 (△)	346,311	
19	6	オフ・バランス取引に関する額 (ニ)	288,140	
連結レバレッジ比率 (5)				
20		資本の額 (ホ)	453,843	
21	8	総エクスポージャーの額 ((イ) + (ロ) + (ハ) + (ニ)) (ヘ)	7,326,569	
22		連結レバレッジ比率 (ホ) / (ヘ)	6.19%	