

「連結レバレッジ比率の構成に関する事項」

＜みずほ信託銀行＞
平成28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28年9月末	平成27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	6,583,250	6,984,143
1a	1	連結貸借対照表における総資産の額	6,894,012	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 (△)	310,761	138,064
2	7	Tier1資本に係る調整項目の額 (△)	48,136	24,596
3		オン・バランス資産の額 (イ)	6,535,114	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	20,145	16,664
5		デリバティブ取引等に関するアドオンの額	31,625	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	27,579	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)	79,350	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	110,036	-
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	11,831	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)	121,868	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	586,580	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 (△)	321,924	346,311
19	6	オフ・バランス取引に関する額 (ニ)	264,656	288,140
連結レバレッジ比率 (5)				
20		資本の額 (ホ)	451,668	453,843
21	8	総エクスポージャーの額 ((イ) + (ロ) + (ハ) + (ニ)) (ヘ)	7,000,989	7,326,569
22		連結レバレッジ比率 (ホ) / (ヘ)	6.45%	6.19%