

「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12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12月末	平成28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	6,589,541	6,583,250
1a	1	連結貸借対照表における総資産の額	7,039,738	6,894,012
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 ()	450,196	310,761
2	7	Tier1資本に係る調整項目の額 ()	48,786	48,136
3		オン・バランス資産の額 (イ)	6,540,755	6,535,114
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	15,770	20,145
5		デリバティブ取引等に関するアドオンの額	31,040	31,625
		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	28,254	27,579
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)	75,065	79,350
レボ取引等に関する額 (3)				
12		レボ取引等に関する資産の額	281,344	110,036
13		レボ取引等に関する資産の額から控除した額 ()	-	-
14		レボ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	10,733	11,831
15		代理取引のエクスポージャーの額	-	-
16	5	レボ取引等に関する額 (ハ)	292,078	121,868
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	582,526	586,580
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 ()	316,400	321,924
19	6	オフ・バランス取引に関する額 (ニ)	266,125	264,656
連結レバレッジ比率 (5)				
20		資本の額 (ホ)	465,830	451,668
21	8	総エクスポージャーの額 ((イ)+(ロ)+(ハ)+(ニ)) (ヘ)	7,174,025	7,000,989
22		連結レバレッジ比率 ((ホ) / (ヘ))	6.49%	6.45%