

「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29年3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29年3月末	平成28年3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	6,544,236	6,966,012
1a	1	連結貸借対照表における総資産の額	6,793,163	7,383,239
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 ()	248,927	417,226
2	7	Tier1資本に係る調整項目の額 ()	68,627	46,829
3		オン・バランス資産の額(イ)	6,475,608	6,919,183
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	26,535	21,799
5		デリバティブ取引等に関するアドオンの額	31,778	33,524
		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	21,142	30,155
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)	79,456	85,479
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	113,046	215,970
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	9,347	11,158
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)	122,393	227,128
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	554,054	601,735
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 ()	313,055	330,808
19	6	オフ・バランス取引に関する額(ニ)	240,999	270,926
連結レバレッジ比率 (5)				
20		資本の額(ホ)	466,406	440,404
21	8	総エクスポージャーの額(イ)+(ロ)+(ハ)+(ニ))(ヘ)	6,918,458	7,502,717
22		連結レバレッジ比率((ホ)/(ヘ))	6.74%	5.86%

「前連結会計年度の連結レバレッジ比率との間に著しい差異が生じた原因」

外国証券をはじめとした有価証券の減少等により、総エクスポージャーが減少したものの。