

レバレッジ比率の構成に関する事項

みずほ信託銀行【連結】
2019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	2019年12月末	2019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	6,779,382	6,927,706
1a	1	連結貸借対照表における総資産の額	7,126,901	7,398,584
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 (△)	347,519	470,877
2	7	Tier1資本に係る調整項目の額 (△)	100,168	100,345
3		オン・バランス資産の額 (イ)	6,679,214	6,827,361
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RCの額に1.4を乗じた額	-	-
		デリバティブ取引等に関する再構築コストの額	8,031	9,552
5		デリバティブ取引等に関するPFEの額に1.4を乗じた額	-	-
		デリバティブ取引等に関するアドオンの額	43,505	43,446
		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	15,825	15,206
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差し入れた担保の対価の額	-	-
		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)	67,362	68,205
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	193,812	286,581
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	2,928	2,655
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)	196,740	289,237
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	477,008	486,941
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 (△)	256,890	271,677
19	6	オフ・バランス取引に関する額 (ニ)	220,117	215,264
連結レバレッジ比率 (5)				
20		資本の額 (ホ)	531,793	510,737
21	8	総エクスポージャーの額 (イ) + (ロ) + (ハ) + (ニ) (ヘ)	7,163,434	7,400,068
22		連結レバレッジ比率 (ホ) / (ヘ)	7.42%	6.90%

「前半期の連結レバレッジ比率との間に著しい差異を生じた原因」

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。