

レバレッジ比率の構成に関する事項

みずほ銀行【単体】
2020年6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	2020年6月末	2020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	139,411,515	161,884,688
	1a	1 貸借対照表における総資産の額	162,764,896	187,214,174
	1b	3 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 (Δ)	23,353,381	25,329,485
2	7	Tier1資本に係る調整項目の額 (Δ)	682,363	673,419
3		オン・バランス資産の額 (イ)	138,729,151	161,211,268
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	1,726,048	1,975,125
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	4,935,049	4,753,743
		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	951,517	919,202
6		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	-	-
		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 (Δ)	-	-
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 (Δ)		
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	1,057,741	269,591
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 (Δ)	1,052,354	264,149
11	4	デリバティブ取引等に関する額 (ロ)	7,618,002	7,653,513
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	7,476,280	8,721,866
13		レポ取引等に関する資産の額から控除した額 (Δ)	59,169	149,709
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	201,606	202,011
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)	7,618,717	8,774,168
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	47,413,448	42,312,567
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 (Δ)	27,023,471	23,824,789
19	6	オフ・バランス取引に関する額 (ニ)	20,389,976	18,487,778
単体レバレッジ比率 (5)				
20		資本の額 (ホ)	8,047,381	7,905,078
21	8	総エクスポージャーの額 (イ) + (ロ) + (ハ) + (ニ) (ヘ)	174,355,847	196,126,728
22		単体レバレッジ比率 (ホ) / (ヘ)	4.61%	4.03%
日本銀行に対する預け金を算入する場合の単体レバレッジ比率 (6)				
		総エクスポージャーの額 (ヘ)	174,355,847	
		日本銀行に対する預け金の額	30,855,793	
		日本銀行に対する預け金を算入する場合の総エクスポージャーの額 (ヘ')	205,211,640	
		日本銀行に対する預け金を算入する場合の単体レバレッジ比率 (ホ) / (ヘ')	3.92%	

「前半期の単体レバレッジ比率との間に著しい差異を生じた原因」

2019年(平成31年)金融庁告示第11号(以下、告示)において、2020年(令和2年)6月30日付告示改正に伴い、日本銀行に対する預け金の額が総エクスポージャーの額より除外されたことによるもの。