

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】
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	5,373,828	6,799,968
	1a	1 連結貸借対照表における総資産の額	5,589,047	7,204,451
	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 (△)	215,218	404,482
2	7	Tier1資本に係る調整項目の額 (△)	101,505	101,064
3		オン・バランス資産の額 (イ)	5,272,322	6,698,904
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	3,983	6,420
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	41,312	44,495
		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	26,211	20,431
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)	71,507	71,347
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	10,139	198,053
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	2,818	6,573
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)	12,958	204,627
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	515,567	488,271
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 (△)	279,262	266,293
19	6	オフ・バランス取引に関する額 (ニ)	236,304	221,977
連結レバレッジ比率 (5)				
20		資本の額 (ホ)	502,280	489,231
21	8	総エクスポージャーの額 ((イ) + (ロ) + (ハ) + (ニ)) (ヘ)	5,593,093	7,196,856
22		連結レバレッジ比率 ((ホ) / (ヘ))	8.98%	6.79%
日本銀行に対する預け金を算入する場合の連結レバレッジ比率 (6)				
		総エクスポージャーの額 (ヘ)	5,593,093	
		日本銀行に対する預け金の額	1,432,679	
		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')	7,025,773	
		日本銀行に対する預け金を算入する場合の連結レバレッジ比率 ((ホ) / (ヘ'))	7.14%	

「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」

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。