

レバレッジ比率の構成に関する事項

みずほ信託銀行【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	5,205,889	6,672,217
	1a	1 貸借対照表における総資産の額	5,421,091	7,076,682
	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)	215,202	404,465
2	7	Tier1資本に係る調整項目の額 (Δ)	68,868	68,043
3		オン・バランス資産の額 (イ)	5,137,021	6,604,173
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		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	-	-
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)	-	-
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 (Δ)	-	-
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	32,995	37,021
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)	43,135	235,075
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	531,250	503,953
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)	293,392	280,423
19	6	オフ・バランス取引に関する額 (ニ)	237,858	223,529
単体レバレッジ比率 (5)				
20		資本の額 (ホ)	489,077	475,276
21	8	総エクスポージャーの額 (イ) + (ロ) + (ハ) + (ニ) (ヘ)	5,489,522	7,134,125
22		単体レバレッジ比率 (ホ) / (ヘ)	8.90%	6.66%
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)	5,489,522	
		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')	6,922,202	
		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')	7.06%	

「前四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。