

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9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9月末	2020年6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	4,819,258	5,205,889
	1a	1 貸借対照表における総資産の額	5,054,793	5,421,091
	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 (△)	235,535	215,202
2	7	Tier1資本に係る調整項目の額 (△)	75,729	68,868
3		オン・バランス資産の額 (イ)	4,743,528	5,137,021
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	3,158	3,983
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	40,515	41,312
		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	24,151	26,211
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 (△)	-	-
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)	67,826	71,507
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	32,855	10,139
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	37,660	32,995
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)	70,516	43,135
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	511,002	531,250
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 (△)	282,979	293,392
19	6	オフ・バランス取引に関する額 (ニ)	228,023	237,858
単体レバレッジ比率 (5)				
20		資本の額 (ホ)	493,670	489,077
21	8	総エクスポージャーの額 (イ) + (ロ) + (ハ) + (ニ) (ヘ)	5,109,894	5,489,522
22		単体レバレッジ比率 (ホ) / (ヘ)	9.66%	8.90%
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)	5,109,894	5,489,522
		日本銀行に対する預け金の額	2,218,787	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')	7,328,681	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')	6.73%	7.06%

「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」

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。