

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	2020年12月末	2020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	4,467,249	4,969,217
1a	1	連結貸借対照表における総資産の額	4,683,155	5,204,766
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 (△)	215,905	235,548
2	7	Tier1資本に係る調整項目の額 (△)	106,797	106,555
3		オン・バランス資産の額 (イ)	4,360,452	4,862,662
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	3,006	3,158
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	40,051	40,515
		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	18,882	24,151
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)	61,940	67,826
レボ取引等に関する額 (3)				
12		レボ取引等に関する資産の額	30,489	32,855
13		レボ取引等に関する資産の額から控除した額 (△)	-	-
14		レボ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	99	5,014
15		代理取引のエクスポージャーの額		
16	5	レボ取引等に関する額 (ハ)	30,588	37,870
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	494,963	500,715
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 (△)	263,839	273,709
19	6	オフ・バランス取引に関する額 (ニ)	231,124	227,005
連結レバレッジ比率 (5)				
20		資本の額 (ホ)	519,001	509,066
21	8	総エクスポージャーの額 (イ) + (ロ) + (ハ) + (ニ) (ヘ)	4,684,104	5,195,364
22		連結レバレッジ比率 (ホ) / (ヘ)	11.08%	9.79%
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)	4,684,104	5,195,364
		日本銀行に対する預け金の額	2,192,356	2,218,787
		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')	6,876,461	7,414,151
		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')	7.54%	6.86%

「前四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。