

## 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
<b>オン・バランス資産の額 (1)</b>				
1		調整項目控除前のオン・バランス資産の額	4,305,533	4,819,258
	1a	1 貸借対照表における総資産の額	4,521,426	5,054,793
	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 (△)	215,892	235,535
2	7	Tier1資本に係る調整項目の額 (△)	76,389	75,729
3		オン・バランス資産の額 (イ)	4,229,143	4,743,528
<b>デリバティブ取引等に関する額 (2)</b>				
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		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)	61,940	67,826
<b>レポ取引等に関する額 (3)</b>				
12		レポ取引等に関する資産の額	30,489	32,855
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	30,489	37,660
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)	60,978	70,516
<b>オフ・バランス取引に関する額 (4)</b>				
17		オフ・バランス取引の想定元本の額	505,250	511,002
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 (△)	273,109	282,979
19	6	オフ・バランス取引に関する額 (ニ)	232,141	228,023
<b>単体レバレッジ比率 (5)</b>				
20		資本の額 (ホ)	502,667	493,670
21	8	総エクスポージャーの額 (イ) + (ロ) + (ハ) + (ニ) (ヘ)	4,584,203	5,109,894
22		単体レバレッジ比率 (ホ) / (ヘ)	10.96%	9.66%
<b>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)</b>				
		総エクスポージャーの額 (ヘ)	4,584,203	5,109,894
		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')	6,776,560	7,328,681
		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')	7.41%	6.73%

### 「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」

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。