

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】
2023年3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	2023年3月末	2022年12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	3,843,976	3,899,412	
	1a	1	貸借対照表における総資産の額	3,902,313	3,996,722
	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)	58,336	97,309
2	7	Tier1資本に係る調整項目の額 (Δ)	63,795	62,578	
3		オン・バランス資産の額 (イ)	3,780,180	3,836,833	
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	13,670	26,590	
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	14,854	13,187	
		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	3,084	-	
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)	31,610	39,778	
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	20,177	40,216	
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	20,177	40,216	
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)	40,355	80,432	
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	485,016	500,086	
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)	263,861	274,380	
19	6	オフ・バランス取引に関する額 (ニ)	221,155	225,705	
単体レバレッジ比率 (5)					
20		資本の額 (ホ)	425,277	446,792	
21	8	総エクスポージャーの額 (イ) + (ロ) + (ハ) + (ニ) (ヘ)	4,073,301	4,182,750	
22		単体レバレッジ比率 (ホ) / (ヘ)	10.44%	10.68%	
		適用する所要単体レバレッジ比率	3.00%		
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)	4,073,301	4,182,750	
		日本銀行に対する預け金の額	2,689,097	2,275,243	
		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')	6,762,398	6,457,993	
		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')	6.28%	6.91%	