

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	2023年6月末	2023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	3,789,525	3,843,976
	1a	1 貸借対照表における総資産の額	4,110,353	3,902,313
	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)	320,827	58,336
2	7	Tier1資本に係る調整項目の額 (Δ)	65,821	63,795
3		オン・バランス資産の額 (イ)	3,723,703	3,780,180
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	9,693	13,670
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	14,103	14,854
		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	7,609	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)	31,406	31,610
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	280,318	20,177
13		レボ取引等に関する資産の額から控除した額 (Δ)	-	-
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	75	20,177
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)	280,394	40,355
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	485,944	485,016
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)	257,057	263,861
19	6	オフ・バランス取引に関する額 (ニ)	228,887	221,155
単体レバレッジ比率 (5)				
20		資本の額 (ホ)	439,663	425,277
21	8	総エクスポージャーの額 (イ) + (ロ) + (ハ) + (ニ) (ヘ)	4,264,391	4,073,301
22		単体レバレッジ比率 (ホ) / (ヘ)	10.31%	10.44%
		適用する所要単体レバレッジ比率	3.00%	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)	4,264,391	4,073,301
		日本銀行に対する預け金の額	2,428,711	2,689,097
		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')	6,693,103	6,762,398
		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')	6.56%	6.28%