

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】
2024年3月末

(単位：百万円、%)

項番(国際 様式(LR1) の該当番 号)	項目	2024年3月末	2023年12月末
1	貸借対照表における総資産の額	4,940,223	
3	リスク移転の認識に係る要件を充足しない証券化エクスポージャーに係る調整	-	
4	中央銀行預け金に係る除外による調整(△)	1,133,176	
5	顧客資産のうち、貸借対照表に計上されている金額(△)		
6	有価証券の売買を約定日基準により会計処理している場合における調整項目	-	
7	キャッシュ・プーリング契約に基づく資金の移動に係る調整項目	-	
8	デリバティブ取引等に関する調整額	△ 20,729	
8a	デリバティブ取引等に関する額	5,480	
8b	デリバティブ取引等に関連する資産の額(△)	26,209	
9	レボ取引等に関する調整額	20,066	
9a	レボ取引等に関する額	40,133	
9b	レボ取引等に関する額(△)	20,066	
10	オフ・バランス取引に関する額	229,427	
11	Tier1資本に係る調整項目の額(貸倒引当金)(△)	4,136	
12	その他の調整項目	△ 82,077	
12a	Tier1資本に係る調整項目の額(貸倒引当金以外)(△)	67,935	
12b	支払承諾見返勘定の額(△)	14,142	
12c	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(相殺した額に相当する部分に限る。)	-	
12d	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(△)	-	
13	総エクスポージャーの額	3,949,597	

みずほ信託銀行【単体】
2024年3月末

(単位：百万円、%)

項番(国際様式(LR2)の該当番号)	項目	2024年3月末	2023年12月末
オン・バランス資産の額(1)			
1	個別項目調整前のオン・バランス資産の額	3,746,627	
2	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(相殺した額に相当する部分に限る。)	-	
3	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(Δ)	-	
4	レボ取引等により受領した証券の計上額(Δ)	-	
5	Tier1資本に係る調整項目の額(貸倒引当金)(Δ)	4,136	
6	Tier1資本に係る調整項目の額(貸倒引当金以外)(Δ)	67,935	
7	オン・バランス資産の額(イ)	3,674,556	
デリバティブ取引等に関する額(2)			
8	デリバティブ取引等に関するRCの額に1.4を乗じた額	-	
9	デリバティブ取引等に関するPFEの額に1.4を乗じた額	5,480	
10	間接清算参加者に適格中央清算機関の債務履行を保証していない場合に零とした中央清算機関向けエクスポージャーの額(Δ)	-	
11	クレジット・デリバティブ等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	-	
12	クレジット・デリバティブ等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)	-	
13	デリバティブ取引等に関する額(ロ)	5,480	
レボ取引等に関する額(3)			
14	レボ取引等に関する資産の額	20,066	
15	レボ取引等に関する資産の額から控除した額(Δ)	-	
16	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	20,066	
17	代理取引のエクスポージャーの額		
18	レボ取引等に関する額(ハ)	40,133	
オフ・バランス取引に関する額(4)			
19	オフ・バランス取引の想定元本の額	670,134	
20	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)	440,706	
22	オフ・バランス取引に関する額(ニ)	229,427	
単体レバレッジ比率(5)			
23	資本の額(ホ)	446,717	
24	総エクスポージャーの額((イ)+(ロ)+(ハ)+(ニ))(ヘ)	3,949,597	
25	単体レバレッジ比率((ホ)/(ヘ))	11.31%	
26	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)	3,949,597	
	日本銀行に対する預け金の額	1,133,176	
	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')	5,082,774	
	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'))	8.78%	
平均値の開示(7)			
28	レボ取引等に関する資産の額(控除後)に係る平均値((ト)+(チ))	28,381	
	レボ取引等に関する資産の額に係る平均値(ト)	28,381	
	レボ取引等に関する資産の額から控除した額に係る平均値(Δ)(チ)	-	
29	レボ取引等に関する資産の額(控除後)に係る四半期末の値((リ)+(ヌ))	20,066	
14	レボ取引等に関する資産の額に係る四半期末の値(リ)	20,066	
15	レボ取引等に関する資産の額から控除した額に係る四半期末の値(Δ)(ヌ)	-	
30	総エクスポージャーの額 (レボ取引等に関する資産の額(控除後)に係る平均値を使用し、日本銀行に対する預け金を算入しない場合)(ル)	3,957,912	
30a	総エクスポージャーの額 (レボ取引等に関する資産の額(控除後)に係る平均値を使用し、日本銀行に対する預け金を算入する場合)(ヲ)	5,091,088	
31	単体レバレッジ比率 (レボ取引等に関する資産の額(控除後)に係る平均値を使用し、日本銀行に対する預け金を算入しない場合)((ホ)/(ル))	11.28%	
31a	単体レバレッジ比率 (レボ取引等に関する資産の額(控除後)に係る平均値を使用し、日本銀行に対する預け金を算入する場合)((ホ)/(ヲ))	8.77%	

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】
2024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	2024年3月末	2023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		3,748,646
	1a	1 貸借対照表における総資産の額		3,809,973
	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 (△)		61,327
2	7	Tier1資本に係る調整項目の額 (△)		68,870
3		オン・バランス資産の額 (イ)		3,679,776
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		15,562
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		13,792
		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		1,296
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)		30,652
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		20,145
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		20,145
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)		40,290
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		468,811
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 (△)		239,553
19	6	オフ・バランス取引に関する額 (ニ)		229,258
単体レバレッジ比率 (5)				
20		資本の額 (ホ)		456,394
21	8	総エクスポージャーの額 ((イ) + (ロ) + (ハ) + (ニ)) (ヘ)		3,979,977
22		単体レバレッジ比率 ((ホ) / (ヘ))		11.46%
		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)		3,979,977
		日本銀行に対する預け金の額		2,210,328
		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')		6,190,305
		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'))		7.37%