

自己資本比率の算式における分母の額に関する開示事項

みずほ信託銀行【単体】
平成30年6月末

(単位：百万円)

0V1:リスク・アセットの概要		イ	ロ	ハ	ニ
国際様式 の該 当番号		リスク・アセット		所要自己資本	
		平成30年6月末	平成30年3月末	平成30年6月末	平成30年3月末
1	信用リスク	1,407,244	1,417,838	118,881	119,751
2	うち、標準的手法適用分	-	-	-	-
3	うち、内部格付手法適用分	1,312,957	1,317,642	111,338	111,736
	うち、重要な出資のエクスポージャー	-	-	-	-
	うち、リース取引における見積残存価額のエクスポージャー	-	-	-	-
	その他	94,287	100,195	7,542	8,015
4	カウンターパーティ信用リスク	17,304	18,711	1,407	1,525
5	うち、SA-CCR適用分	-	-	-	-
	うち、カレント・エクスポージャー方式適用分	1	42	0	3
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	1,702	2,352	144	199
	うち、CVAリスク	12,481	12,772	998	1,021
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	92	71	7	5
	その他	3,027	3,472	256	294
7	マーケット・ベース方式に基づく株式等エクスポージャー	596,759	481,222	50,605	40,807
	複数の資産及び取引を裏付けとするエクスポージャー	-	-	-	-
	信用リスク・アセットのみなし計算が適用されるエクスポージャー	171,871	148,395	14,574	12,583
11	未決済取引	-	-	-	-
12	信用リスク・アセットの額の算出対象となっている証券化エクスポージャー	4,443	4,506	376	382
13	うち、内部格付手法における外部格付準拠方式又は内部評価方式適用分	1,832	1,895	155	160
14	うち、内部格付手法における指定関数方式適用分	2,611	2,611	221	221
15	うち、標準的手法適用分	-	-	-	-
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	-	-	-	-
16	マーケット・リスク	28,685	29,067	2,294	2,325
17	うち、標準的方式適用分	14,274	16,612	1,141	1,329
18	うち、内部モデル方式適用分	14,410	12,454	1,152	996
19	オペレーショナル・リスク	234,103	234,090	18,728	18,727
20	うち、基礎的手法適用分	-	-	-	-
21	うち、粗利益配分手法適用分	-	-	-	-
22	うち、先進的計測手法適用分	234,103	234,090	18,728	18,727
23	特定項目のうち、調整項目に算入されない部分に係るエクスポージャー	25,781	32,571	2,072	2,615
	経過措置によりリスク・アセットの額に算入されるものの額	-	-	-	-
24	フロア調整	-	-	-	-
25	合計(スケーリング・ファクター勘案後)	2,611,756	2,483,978	208,940	198,718