

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9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9月末	平成30年6月末	平成30年9月末	平成30年6月末
1	信用リスク	1,366,580	1,407,244	115,413	118,881
2	うち、標準的手法適用分	-	-	-	-
3	うち、内部格付手法適用分	1,268,101	1,312,957	107,534	111,338
	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	98,479	94,287	7,878	7,542
4	カウンターパーティ信用リスク	16,926	17,304	1,381	1,407
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	0	1	0	0
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	2,745	1,702	232	144
	うち、CVAリスク	11,107	12,481	888	998
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	74	92	5	7
	その他	2,999	3,027	254	256
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	496,181	596,759	42,076	50,605
	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	142,045	171,871	12,045	14,574
11	未決済取引	5,202	-	441	-
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	4,321	4,443	366	376
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	1,710	1,832	145	155
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	27,774	28,685	2,221	2,294
17	うち、標準的方式適用分	18,033	14,274	1,442	1,141
18	うち、内部モデル方式適用分	9,740	14,410	779	1,152
19	オペレーショナル・リスク	238,288	234,103	19,063	18,728
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	238,288	234,103	19,063	18,728
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	31,034	25,781	2,492	2,072
	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)	2,443,775	2,611,756	195,502	208,940