

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】
2018年12月末

(単位：百万円)

OV1：リスク・アセットの概要					
国際様式 の該 当番号		イ	ロ	ハ	ニ
		リスク・アセット		所要自己資本	
		2018年12月末	2018年9月末	2018年12月末	2018年9月末
1	信用リスク	1,313,199	1,366,580	110,941	115,413
2	うち、標準的手法適用分	-	-	-	-
3	うち、内部格付手法適用分	1,226,247	1,268,101	103,985	107,534
	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	86,951	98,479	6,956	7,878
4	カウンターパーティ信用リスク	12,846	16,926	1,051	1,381
5	うち、S A C C R 適用分	-	-	-	-
	うち、カレント・エクスポージャー方式適用分	-	0	-	0
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	1,567	2,745	132	232
	うち、C V A リスク	7,806	11,107	624	888
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	109	74	8	5
	その他	3,362	2,999	285	254
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	475,989	496,181	40,363	42,076
	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	78,227	142,045	6,633	12,045
11	未決済取引	15,252	5,202	1,293	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	4,435	4,321	376	366
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	1,824	1,710	154	145
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	16,116	27,774	1,289	2,221
17	うち、標準的方式適用分	1,590	18,033	127	1,442
18	うち、内部モデル方式適用分	14,526	9,740	1,162	779
19	オペレーショナル・リスク	238,857	238,288	19,108	19,063
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	238,857	238,288	19,108	19,063
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	56,855	31,034	4,557	2,492
	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)	2,320,194	2,443,775	185,615	195,502