

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】

2019年3月末

(単位:百万円)

国際様式の 該当番号	0V1:リスク・アセットの概要	イ	ロ	ハ	ニ
		リスク・アセット		所要自己資本	
		2019年3月末	2018年12月末	2019年3月末	2018年12月末
1	信用リスク	1,284,323	1,313,199	108,479	110,941
2	うち、標準的手法適用分	-	-	-	-
3	うち、内部格付手法適用分	1,194,461	1,226,247	101,290	103,985
	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	89,861	86,951	7,188	6,956
4	カウンターパーティ信用リスク	11,152	12,846	912	1,051
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	2,016	1,567	170	132
	うち、C V Aリスク	6,769	7,806	541	624
	うち、中央清算機関連エクスポージャー	85	109	6	8
	その他	2,280	3,362	193	285
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	312,254	475,989	26,479	40,363
8	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算(ルック・スルー方式)	75,872		6,407	
9	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算(マンデート方式)	-		-	
	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算(蓋然性方式250%)	-		-	
	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算(蓋然性方式400%)	3,548		300	
10	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算(フォールバック方式1250%)	11		0	
	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spoージャー		78,227		6,633
11	未決済取引	-	15,252	-	1,293
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spoージャー	6,413	4,435	513	376
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	6,413		513	
14	うち、外部格付準拠方式適用分	-		-	
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	-		-	
	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		154
	うち、内部格付手法における指定閾数方式適用分		2,611		221
	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	6,439	16,116	515	1,289
17	うち、標準的方式適用分	202	1,590	16	127
18	うち、内部モデル方式適用分	6,237	14,526	498	1,162
19	オペレーション・リスク	247,269	238,857	19,781	19,108
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	247,269	238,857	19,781	19,108
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spoージャー	52,259	56,855	4,187	4,557
	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)	2,094,734	2,320,194	167,578	185,615