

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	
		2019年6月末	2019年3月末	2019年6月末	2019年3月末
1	信用リスク	1,263,029	1,284,323	106,676	108,479
2	うち、標準的手法適用分	-	-	-	-
3	うち、内部格付手法適用分	1,173,805	1,194,461	99,538	101,290
	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	89,223	89,861	7,137	7,188
4	カウンターパーティ信用リスク	11,103	11,152	910	912
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	-	0
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	2,011	2,016	170	170
	うち、CVAリスク	6,462	6,769	517	541
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	104	85	8	6
	その他	2,524	2,280	214	193
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	316,727	312,254	26,858	26,479
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）	76,226	75,872	6,434	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（マンドート方式）	-	-	-	-
	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	11	0	0
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	3,376	6,413	270	513
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	3,376	6,413	270	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、1250%のリスク・ウェイト適用分	-	-	-	-
16	マーケット・リスク	11,292	6,439	903	515
17	うち、標準的方式適用分	294	202	23	16
18	うち、内部モデル方式適用分	10,997	6,237	879	498
19	オペレーショナル・リスク	249,132	247,269	19,930	19,781
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	249,132	247,269	19,930	19,781
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	56,692	52,259	4,541	4,187
	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(スケールリング・ファクター勘案後)	2,081,583	2,094,734	166,526	167,578