

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9月末

(単位：百万円)

OV1: 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9月末	2019年6月末	2019年9月末	2019年6月末
1	信用リスク	1,255,775	1,263,029	106,095	106,676
2	うち、標準的手法適用分	-	-	-	-
3	うち、内部格付手法適用分	1,173,658	1,173,805	99,526	99,538
	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	82,116	89,223	6,569	7,137
4	カウンターパーティ信用リスク	10,399	11,103	851	910
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	1,770	2,011	150	170
	うち、C V Aリスク	6,242	6,462	499	517
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	84	104	6	8
	その他	2,301	2,524	195	214
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	357,528	316,727	30,318	26,858
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)	93,282	76,226	7,880	6,434
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%)	-	-	-	-
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%)	12	11	1	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	3,356	3,376	268	270
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	3,356	3,376	268	270
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	7,153	11,292	572	903
17	うち、標準的方式適用分	215	294	17	23
18	うち、内部モデル方式適用分	6,938	10,997	555	879
19	オペレーショナル・リスク	240,737	249,132	19,258	19,930
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	240,737	249,132	19,258	19,930
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	50,413	56,692	4,040	4,541
	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)	2,116,090	2,081,583	169,287	166,526