

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12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12月末	2019年9月末	2019年12月末	2019年9月末
1	信用リスク	1,329,455	1,255,775	111,987	106,095
2	うち、標準的手法適用分	-	-	-	-
3	うち、内部格付手法適用分	1,173,150	1,173,658	99,483	99,526
	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	156,304	82,116	12,504	6,569
4	カウンターパーティ信用リスク	10,995	10,399	899	851
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	1,993	1,770	169	150
	うち、CVAリスク	6,748	6,242	539	499
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	85	84	6	6
	その他	2,167	2,301	183	195
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	428,718	357,528	36,355	30,318
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）	99,972	93,282	8,446	7,880
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%）	325	-	27	-
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%）	14	12	1	1
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	3,335	3,356	266	268
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	3,335	3,356	266	268
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	9,968	7,153	797	572
17	うち、標準的方式適用分	545	215	43	17
18	うち、内部モデル方式適用分	9,423	6,938	753	555
19	オペレーショナル・リスク	239,638	240,737	19,171	19,258
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	239,638	240,737	19,171	19,258
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	34,641	50,413	2,779	4,040
	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)	2,259,154	2,116,090	180,732	169,287