

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】
2020年3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	
		2020年3月末	2019年12月末	2020年3月末	2019年12月末
1	信用リスク	1,301,984	1,329,455	109,630	111,987
2	うち、標準的手法適用分	-	-	-	-
3	うち、内部格付手法適用分	1,139,963	1,173,150	96,668	99,483
	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	162,020	156,304	12,961	12,504
4	カウンターパーティ信用リスク	15,298	10,995	1,252	899
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	37	-	3	-
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	3,093	1,993	262	169
	うち、CVAリスク	9,138	6,748	731	539
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	127	85	10	6
	その他	2,901	2,167	246	183
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	231,426	428,718	19,624	36,355
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）	78,141	99,972	6,596	8,446
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%）	2,058	325	174	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%）	13	14	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	3,658	3,335	292	266
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	3,658	3,335	292	266
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	13,183	9,968	1,054	797
17	うち、標準的方式適用分	7	545	0	43
18	うち、内部モデル方式適用分	13,176	9,423	1,054	753
19	オペレーショナル・リスク	257,315	239,638	20,585	19,171
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	257,315	239,638	20,585	19,171
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	66,602	34,641	5,334	2,779
	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）	2,056,842	2,259,154	164,547	180,732