

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6月末

(単位：百万円)

国際様式の 該当番号	OV1: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	
		2020年6月末	2020年3月末	2020年6月末	2020年3月末
1	信用リスク	1,358,805	1,301,984	114,442	109,630
2	うち、標準的手法適用分	-	-	-	-
3	うち、内部格付手法適用分	1,195,451	1,139,963	101,374	96,668
	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	163,354	162,020	13,068	12,961
4	カウンターパーティ信用リスク	14,278	15,298	1,167	1,252
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	13	37	1	3
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	2,993	3,093	253	262
	うち、CVAリスク	8,923	9,138	713	731
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	91	127	7	10
	その他	2,257	2,901	191	246
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	260,468	231,426	22,087	19,624
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）	25,397	78,141	2,100	6,596
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%）	350	2,058	29	174
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	13	1	1
11	未決済取引	17,200	-	1,458	-
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	26,796	3,658	2,143	292
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	26,796	3,658	2,143	292
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	11,799	13,183	943	1,054
17	うち、標準的方式適用分	7	7	0	0
18	うち、内部モデル方式適用分	11,792	13,176	943	1,054
19	オペレーショナル・リスク	256,910	257,315	20,552	20,585
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	256,910	257,315	20,552	20,585
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	55,049	66,602	4,409	5,334
	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）	2,116,735	2,056,842	169,338	164,547