

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9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	
		2020年9月末	2020年6月末	2020年9月末	2020年6月末
1	信用リスク	1,331,576	1,358,805	112,083	114,442
2	うち、標準的手法適用分	-	-	-	-
3	うち、内部格付手法適用分	1,157,791	1,195,451	98,180	101,374
	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	173,784	163,354	13,902	13,068
4	カウンターパーティ信用リスク	16,481	14,278	1,355	1,167
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	-	1
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	3,064	2,993	259	253
	うち、CVAリスク	8,612	8,923	689	713
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	80	91	6	7
	その他	4,723	2,257	400	191
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	130,890	260,468	11,099	22,087
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）	28,522	25,397	2,370	2,100
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	-	29
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	13	1	1
11	未決済取引	2,022	17,200	171	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	26,026	26,796	2,082	2,143
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	26,026	26,796	2,082	2,143
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	19,035	11,799	1,522	943
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	19,027	11,792	1,522	943
19	オペレーショナル・リスク	248,969	256,910	19,917	20,552
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	248,969	256,910	19,917	20,552
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	53,898	55,049	4,317	4,409
	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)	1,936,535	2,116,735	154,922	169,338