

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	
		2020年12月末	2020年9月末	2020年12月末	2020年9月末
1	信用リスク	1,353,536	1,331,576	113,988	112,083
2	うち、標準的手法適用分	-	-	-	-
3	うち、内部格付手法適用分	1,188,683	1,157,791	100,800	98,180
	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	164,852	173,784	13,188	13,902
4	カウンターパーティ信用リスク	12,422	16,481	1,020	1,355
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	-	-	-	-
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	1,665	3,064	141	259
	うち、CVAリスク	6,862	8,612	548	689
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	70	80	5	6
	その他	3,824	4,723	324	400
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	39,809	130,890	3,375	11,099
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）	28,606	28,522	2,378	2,370
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%）	14	14	1	1
11	未決済取引	297	2,022	25	171
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	24,022	26,026	1,921	2,082
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	24,022	26,026	1,921	2,082
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	21,944	19,035	1,755	1,522
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	21,936	19,027	1,754	1,522
19	オペレーショナル・リスク	251,396	248,969	20,111	19,917
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	251,396	248,969	20,111	19,917
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	48,476	53,898	3,884	4,317
	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)	1,855,783	1,936,535	148,462	154,922