

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】
2021年3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	
		2021年3月末	2020年12月末	2021年3月末	2020年12月末
1	信用リスク	1,343,788	1,353,536	113,172	113,988
2	うち、標準的手法適用分	-	-	-	-
3	うち、内部格付手法適用分	1,181,115	1,188,683	100,158	100,800
	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	162,673	164,852	13,013	13,188
4	カウンターパーティ信用リスク	21,350	12,422	1,756	1,020
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	6,283	-	532	-
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	1,665	-	141
	うち、CVAリスク	10,754	6,862	860	548
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	536	70	42	5
	その他	3,775	3,824	320	324
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	41,342	39,809	3,505	3,375
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）	28,562	28,606	2,376	2,378
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%）	12	14	1	1
11	未決済取引	298	297	25	25
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	763	24,022	61	1,921
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	763	24,022	61	1,921
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	26,361	21,944	2,108	1,755
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	26,354	21,936	2,108	1,754
19	オペレーショナル・リスク	243,393	251,396	19,471	20,111
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	243,393	251,396	19,471	20,111
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	32,479	48,476	2,605	3,884
	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)	1,813,555	1,855,783	145,084	148,462