

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6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6月末	2021年3月末	2021年6月末	2021年3月末
1	信用リスク	1,299,694	1,343,788	109,444	113,172
2	うち、標準的手法適用分	-	-	-	-
3	うち、内部格付手法適用分	1,139,458	1,181,115	96,626	100,158
	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	160,236	162,673	12,818	13,013
4	カウンターパーティ信用リスク	17,063	21,350	1,405	1,756
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	4,619	6,283	391	532
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	8,297	10,754	663	860
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	350	536	28	42
	その他	3,795	3,775	321	320
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	46,151	41,342	3,913	3,505
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）	32,725	28,562	2,728	2,376
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	12	1	1
11	未決済取引	298	298	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	739	763	59	61
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	739	763	59	61
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	23,278	26,361	1,862	2,108
17	うち、標準的方式適用分	2	7	0	0
18	うち、内部モデル方式適用分	23,275	26,354	1,862	2,108
19	オペレーショナル・リスク	243,190	243,393	19,455	19,471
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	243,190	243,393	19,455	19,471
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	31,284	32,479	2,509	2,605
	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）	1,767,558	1,813,555	141,404	145,084