

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	
		2021年9月末	2021年6月末	2021年9月末	2021年6月末
1	信用リスク	1,278,117	1,299,694	107,686	109,444
2	うち、標準的手法適用分	-	-	-	-
3	うち、内部格付手法適用分	1,132,796	1,139,458	96,061	96,626
	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	145,320	160,236	11,625	12,818
4	カウンターパーティ信用リスク	5,788	17,063	490	1,405
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	-	391
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	-	663
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	151	350	12	28
	その他	5,637	3,795	478	321
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	107,434	46,151	9,110	3,913
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）	33,517	32,725	2,791	2,728
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	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	718	739	57	59
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	718	739	57	59
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	15,831	23,278	1,266	1,862
17	うち、標準的方式適用分	1	2	0	0
18	うち、内部モデル方式適用分	15,829	23,275	1,266	1,862
19	オペレーショナル・リスク	245,279	243,190	19,622	19,455
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	245,279	243,190	19,622	19,455
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	21,586	31,284	1,734	2,509
	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)	1,784,827	1,767,558	142,786	141,404