

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	
		2021年12月末	2021年9月末	2021年12月末	2021年9月末
1	信用リスク	1,255,029	1,278,117	105,716	107,686
2	うち、標準的手法適用分	-	-	-	-
3	うち、内部格付手法適用分	1,107,169	1,132,796	93,887	96,061
	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	147,859	145,320	11,828	11,625
4	カウンターパーティ信用リスク	2,884	5,788	243	490
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	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	-	-	-	-
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	177	151	14	12
	その他	2,707	5,637	229	478
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	110,825	107,434	9,398	9,110
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）	33,708	33,517	2,807	2,791
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%）	680	-	57	-
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%）	13	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	703	718	56	57
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	703	718	56	57
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	93	15,831	7	1,266
17	うち、標準的方式適用分	93	1	7	0
18	うち、内部モデル方式適用分	-	15,829	-	1,266
19	オペレーショナル・リスク	244,995	245,279	19,599	19,622
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	244,995	245,279	19,599	19,622
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	21,508	21,586	1,727	1,734
	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）	1,745,506	1,784,827	139,640	142,786