

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【連結】  
平成30年9月末

(単位：百万円)

OV1：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	
		平成30年9月末	平成30年6月末	平成30年9月末	平成30年6月末
1	信用リスク	1,304,850	1,345,254	109,999	113,450
2	うち、標準的手法適用分	15,811	16,523	1,264	1,321
3	うち、内部格付手法適用分	1,169,129	1,214,700	99,142	103,006
	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	119,909	114,030	9,592	9,122
4	カウンターパーティ信用リスク	14,700	15,075	1,192	1,218
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	0	1	0	0
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	2,745	1,702	232	144
	うち、CVAリスク	11,107	12,481	888	998
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	74	92	5	7
	その他	772	798	65	67
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	519,363	619,770	44,042	52,556
	複数の資産及び取引を裏付けとするエクスポージャー	-	-	-	-
	信用リスク・アセットのみなし計算が適用されるエクスポージャー	147,847	177,726	12,537	15,071
11	未決済取引	5,202	-	441	-
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	4,321	4,443	366	376
13	うち、内部格付手法における外部格付準拠方式又は内部評価方式適用分	1,710	1,832	145	155
14	うち、内部格付手法における指定関数方式適用分	2,611	2,611	221	221
15	うち、標準的手法適用分	-	-	-	-
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	-	-	-	-
16	マーケット・リスク	28,815	30,158	2,305	2,412
17	うち、標準的方式適用分	19,074	15,747	1,525	1,259
18	うち、内部モデル方式適用分	9,740	14,410	779	1,152
19	オペレーショナル・リスク	281,537	275,945	22,522	22,075
20	うち、基礎的手法適用分	43,248	41,841	3,459	3,347
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	238,288	234,103	19,063	18,728
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	38,313	31,728	3,089	2,561
	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)	2,456,216	2,621,546	196,497	209,723

みずほ信託銀行【連結】  
平成30年9月末

(単位：億円)

CR8：内部格付手法を適用した信用リスク・エクスポージャーのリスク・アセット変動表			
項番		信用リスク・アセットの額	
1	前四半期末時点における信用リスク・アセットの額	19,130	
2	当四半期中の要因別の変動額	資産の規模	△ 1,320
3		ポートフォリオの質	△ 125
4		モデルの更新	-
5		手法及び方針	-
6		買収又は売却	-
7		為替の変動	15
8		その他	6
9		当四半期末時点における信用リスク・アセットの額	17,705

- 注) 1. カウンターパーティ信用リスク、証券化エクスポージャー、信用リスク・アセットのみなし計算が適用されるエクスポージャーを除いています。
2. 資産の規模は、会計上の資産の増減、新規事業の取組による資産の増加及び債権の満期到来による資産の減少等に起因するリスク・アセットの変動額です。
3. ポートフォリオの質は、債務者及び案件の格付区分の遷移、担保価値及び保証の変動等に起因するリスク・アセットの変動額です。
4. 為替の変動は、外貨建取引のエクスポージャーが為替変動の影響を受けることに起因するリスク・アセットの変動額です。

みずほ信託銀行【連結】  
平成30年9月末

(単位：億円)

CCR7：期待エクスポージャー方式を用いたカウンターパーティ信用リスク・エクスポージャーのリスク・アセット変動表			
項番		信用リスク・アセットの額	
1	前四半期末時点における信用リスク・アセットの額	17.0	
2	当四半期中の要因別の変動額	資産の規模	9.7
3		取引相手方の信用力	-
4		モデルの更新（期待エクスポージャー方式に係る変動のみ）	-
5		手法及び方針（期待エクスポージャー方式に係る変動のみ）	-
6		買収又は売却	-
7		為替の変動	0.6
8		その他	△ 0.0
9	当四半期末時点における信用リスク・アセットの額	27.4	

みずほ信託銀行【連結】  
平成30年9月末

(単位：百万円)

MR2：内部モデル方式を適用して算出されたリスク・アセットの額の変動要因							
項番		イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ
		バリュ- アツト・ リスク	ストレス・ バリュ- アツト・ リスク	追加的 リスク	包括的 リスク	その他	合計
1a	前四半期末におけるリスク・アセット	3,421	10,988	-	-		14,410
1b	前四半期末における自己資本比率規制上の リスク・アセット額への調整	1.82	1.61	-	-		1.66
1c	前四半期末の算出基準日における 内部モデル方式の算出額	1,871	6,802	-	-		8,674
2	当四半期中の 要因別の変動額	リスク量の変動	△ 1,640	△ 5,767	-	-	△ 7,408
3		モデルの更新又は変更	-	-	-	-	-
4		手法及び方針	-	-	-	-	-
5		買収及び売却	-	-	-	-	-
6		為替の変動	53	186	-	-	240
7		その他	△ 56	△ 159	-	-	△ 215
8a	当四半期末の算出基準日における 内部モデル方式の算出額	228	1,062	-	-		1,291
8b	当四半期末における自己資本比率規制上の リスク・アセット額への調整	10.67	6.86	-	-		7.54
8c	当四半期末におけるリスク・アセット	2,441	7,298	-	-		9,740