

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】

2018年12月末

(単位：百万円)

国際様式の該当番号	0V1:リスク・アセットの概要	イ		ハ	
		リスク・アセット		所要自己資本	
		2018年12月末	2018年9月末	2018年12月末	2018年9月末
1	信用リスク	1,243,683	1,304,850	104,906	109,999
2	うち、標準的手法適用分	15,499	15,811	1,239	1,264
3	うち、内部格付手法適用分	1,127,384	1,169,129	95,602	99,142
	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	100,799	119,909	8,063	9,592
4	カウンターパーティ信用リスク	10,605	14,700	861	1,192
5	うち、S A C C R適用分	-	-	-	-
	うち、カレント・エクスポージャー方式適用分	-	0	-	0
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	1,567	2,745	132	232
	うち、C V Aリスク	7,806	11,107	624	888
	うち、中央清算機関連エクスポージャー	109	74	8	5
	その他	1,121	772	95	65
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	498,884	519,363	42,305	44,042
	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spoージャー	84,031	147,847	7,125	12,537
11	未決済取引	15,252	5,202	1,293	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spoージャー	4,435	4,321	376	366
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	1,824	1,710	154	145
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	16,211	28,815	1,296	2,305
17	うち、標準的方式適用分	1,684	19,074	134	1,525
18	うち、内部モデル方式適用分	14,526	9,740	1,162	779
19	オペレーションナル・リスク	282,106	281,537	22,568	22,522
20	うち、基礎的手法適用分	43,248	43,248	3,459	3,459
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	238,857	238,288	19,108	19,063
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spoージャー	63,901	38,313	5,135	3,089
	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)	2,323,361	2,456,216	185,868	196,497

みずほ信託銀行【連結】
2018年12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spoージャーのリスク・アセット変動表		信用リスク・アセットの額
項目		
1	前四半期末時点における信用リスク・アセットの額	17,705
2	当四半期中の要因別の変動額	資産の規模
3		ポートフォリオの質
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
8		その他
9	当四半期末時点における信用リスク・アセットの額	17,108

- 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】
2018年12月末

(単位 : 億円)

CCR7 : 期待エクスポート方式を用いたカウンターパーティ信用リスク・エクスポートのリスク・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	27.4
2	当四半期中の要因別の変動額	資産の規模 $\triangle 11.4$
3		取引相手の信用力
4		モデルの更新 (期待エクスポート方式に係る変動のみ)
5		手法及び方針 (期待エクスポート方式に係る変動のみ)
6		買収又は売却
7		為替の変動 $\triangle 0.3$
8		その他
9	当四半期末時点における信用リスク・アセットの額	15.6

みずほ信託銀行【連結】

2018年12月末

(単位：百万円)

項番	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	イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ
		バリュー・ アット・ リスク	ストレス・ バリュー・ アット・ 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	2,441	7,298	-	-		9,740
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	10.67	6.86	-	-		7.54
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	228	1,062	-	-		1,291
2	当四半期中の要因別の変動額	リスク量の変動	281	659	-	-	941
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	1	△ 24	-		△ 23
7		その他	△ 14	13	-		0
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	497	1,711	-	-		2,208
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	6.76	6.52	-	-		6.57
8c	当四半期末におけるリスク・アセット	3,366	11,159	-	-		14,526