

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】
2020年6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	
		2020年6月末	2020年3月末	2020年6月末	2020年3月末
1	信用リスク	1,298,812	1,239,207	109,187	104,152
2	うち、標準的手法適用分	24,066	17,837	1,925	1,426
3	うち、内部格付手法適用分	1,100,588	1,044,908	93,329	88,608
	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	174,157	176,461	13,932	14,116
4	カウンターパーティ信用リスク	12,413	13,433	1,009	1,094
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	13	37	1	3
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	2,993	3,093	253	262
	うち、CVAリスク	8,923	9,138	713	731
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	91	127	7	10
	その他	391	1,037	33	87
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	282,612	252,423	23,965	21,405
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）	25,397	78,141	2,100	6,596
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%）	3,190	4,898	270	415
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%）	37	36	2	2
11	未決済取引	17,200	-	1,458	-
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	26,796	3,658	2,143	292
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	26,796	3,658	2,143	292
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	13,761	15,695	1,100	1,255
17	うち、標準的方式適用分	1,968	2,519	157	201
18	うち、内部モデル方式適用分	11,792	13,176	943	1,054
19	オペレーショナル・リスク	303,255	303,661	24,260	24,292
20	うち、基礎的手法適用分	46,345	46,345	3,707	3,707
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	256,910	257,315	20,552	20,585
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	60,192	73,201	4,836	5,876
	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）	2,129,213	2,067,316	170,337	165,385

みずほ信託銀行【連結】
2020年6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	14,593	
2	当四半期中の要因別の変動額	資産の規模	605
3		ポートフォリオの質	142
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	△ 1
8		その他	△ 1
9	当四半期末時点における信用リスク・アセットの額	15,339	

- 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. 手法及び方針は、当局による規制の変更による計算手法の変更に起因するリスク・アセットの変動額です。
5. 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】
2020年6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	30.9	
2	当四半期中の要因別の変動額	資産の規模	△ 0.7
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	△ 0.2
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	29.9

みずほ信託銀行【連結】
2020年6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	3,234	9,941	-	-		13,176	
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	4.16	5.57	-	-		5.14	
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	776	1,782	-	-		2,558	
2	当四半期中の 要因別の変動額	リスク量の変動	265	527	-	-		792
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	△ 2	-	-		△ 4
7		その他	13	129	-	-		142
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	1,053	2,437	-	-		3,490	
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	3.43	3.35	-	-		3.37	
8c	当四半期末におけるリスク・アセット	3,616	8,176	-	-		11,792	