

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】
2021年6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6月末	2021年3月末	2021年6月末	2021年3月末
1	信用リスク	1,242,337	1,279,826	104,406	107,604
2	うち、標準的手法適用分	31,120	24,064	2,489	1,925
3	うち、内部格付手法適用分	1,045,661	1,087,086	88,672	92,184
	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	165,555	168,675	13,244	13,494
4	カウンターパーティ信用リスク	13,268	17,574	1,083	1,436
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	6,283	391	532
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	10,754	663	860
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	350	536	28	42
	その他	-	-	-	-
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	68,106	62,453	5,775	5,296
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）	32,725	28,562	2,728	2,376
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%）	2,840	2,840	240	240
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%）	771	772	61	61
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	739	763	59	61
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	739	763	59	61
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	25,156	29,169	2,012	2,333
17	うち、標準的方式適用分	1,880	2,815	150	225
18	うち、内部モデル方式適用分	23,275	26,354	1,862	2,108
19	オペレーショナル・リスク	288,533	288,736	23,082	23,098
20	うち、基礎的手法適用分	45,342	45,342	3,627	3,627
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	243,190	243,393	19,455	19,471
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	35,282	37,234	2,844	3,000
	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）	1,778,999	1,819,189	142,319	145,535

みずほ信託銀行【連結】
2021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	12,954	
2	当四半期中の要因別の変動額	資産の規模	△ 532
3		ポートフォリオの質	157
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	△ 0
8		その他	△ 0
9	当四半期末時点における信用リスク・アセットの額	12,578	

- 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】
2021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	-	
2	当四半期中の要因別の変動額	資産の規模	-
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	-
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	-

みずほ信託銀行【連結】
2021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	5,085	21,268	-	-		26,354	
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	2.56	4.43	-	-		3.89	
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	1,980	4,794	-	-		6,774	
2	当四半期中の 要因別の変動額	リスク量の変動	673	466	-	-		1,140
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	0	△ 0	-	-		△ 0
7		その他	589	0	-	-		589
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	3,243	5,260	-	-		8,504	
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	1.99	3.19	-	-		2.73	
8c	当四半期末におけるリスク・アセット	6,456	16,819	-	-		23,275	