

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	1,189,631	1,222,916	100,034	102,819
2	うち、標準的手法適用分	22,792	33,016	1,823	2,641
3	うち、内部格付手法適用分	1,013,415	1,038,827	85,937	88,092
	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	153,424	151,072	12,273	12,085
4	カウンターパーティ信用リスク	191	181	15	14
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	14	29	1	2
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	135,242	131,408	11,468	11,143
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%）	3,520	2,840	298	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%）	2,499	1,268	199	101
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	436	16,890	34	1,351
17	うち、標準的方式適用分	436	1,061	34	84
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	291,479	291,764	23,318	23,341
20	うち、基礎的手法適用分	46,484	46,484	3,718	3,718
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	20,897	21,116	1,693	1,711
	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）	1,749,414	1,794,984	139,953	143,598

みずほ信託銀行【連結】  
2021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	12,984	
2	当四半期中の要因別の変動額	資産の規模	△ 192
3		ポートフォリオの質	△ 16
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	0
9	当四半期末時点における信用リスク・アセットの額	12,777	

- 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。

(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		イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ
項番		バリュウ・アット・リスク	ストレス・バリュウ・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	5,406	10,423	-	-		15,829
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	214.76	146.36	-	-		164.22
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	25	71	-	-		96
2	当四半期中の 要因別の変動額	リスク量の変動	-	-	-	-	-
3		モデルの更新又は変更	△ 25	△ 71	-	-	△ 96
4		手法及び方針	-	-	-	-	-
5		買収及び売却	-	-	-	-	-
6		為替の変動	-	-	-	-	-
7		その他	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	
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	-	-	-	-		-
8c	当四半期末におけるリスク・アセット	-	-	-	-		-

\* 内部モデル方式の適用は2021年10月に廃止。