

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】

2023年9月末

(単位：百万円)

0V1: リスク・アセットの概要					
国際様式の 該当番号		イ	ロ	ハ	ニ
		リスク・アセット		所要自己資本	
		2023年9月末	2023年6月末	2023年9月末	2023年6月末
1	信用リスク	1,072,747	1,074,986	89,988	90,218
2	うち、標準的手法適用分	20,705	26,442	1,656	2,115
3	うち、内部格付手法適用分	868,387	879,073	73,639	74,545
	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	183,654	169,470	14,692	13,557
4	カウンターパーティ信用リスク	722	539	57	43
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	705	475	56	38
	その他	17	63	1	5
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	138,942	133,381	11,782	11,310
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）	43,543	49,626	3,628	4,153
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%）	3,015	3,011	255	255
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%）	2,982	2,937	238	234
11	未決済取引	-	-	-	-
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	2,302	1,104	184	88
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	2,302	1,104	184	88
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	1,081	2,312	86	184
17	うち、標準的方式適用分	1,081	2,312	86	184
18	うち、内部モデル方式適用分	-	-	-	-
19	オペレーショナル・リスク	324,730	324,772	25,978	25,981
20	うち、基礎的手法適用分	56,226	52,587	4,498	4,207
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	268,504	272,185	21,480	21,774
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	6,432	6,754	534	559
	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）	1,659,176	1,662,894	132,734	133,031

(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		11,176
2	当四半期中の要因別 の変動額	資産の規模	△ 451
3		ポートフォリオの質	371
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		11,096

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。