

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】
2024年3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					
		2024年3月末	2023年12月末	2024年3月末	2023年12月末				
1	信用リスク	1,174,531	1,050,072	93,962	88,134				
2	うち、標準的手法適用分	189,747	27,711	15,179	2,216				
	うち、内部格付手法適用分		860,050		72,932				
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	491,524		39,321					
4	うち、スロットティング・クライテリア適用分	-		-					
5	うち、先進的内部格付手法適用分	346,026		27,682					
	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	147,233	162,310	11,778	12,984				
6	カウンターパーティ信用リスク	1,266	593	101	47				
7	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		0		0				
8	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	571	587	45	46				
9	その他	695	6	55	0				
10	CVAリスク	-	-	-	-				
	うち、SA-CVA適用分	-	-	-	-				
	うち、完全なBA-CVA適用分	-	-	-	-				
	うち、限定的なBA-CVA適用分	-	-	-	-				
	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		145,155		12,309				
11	経過措置により適用されるマーケット・ベース方式に基づく株式等エクスポージャー	181,579		14,526					
12	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）	34,816	43,656	2,785	3,639				
13	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%）	2,453	-	196	-				
	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	-	255				
14	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	2,762	61	221				
15	未決済取引	-	-	-	-				
16	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	3,308	2,297	264	183				
	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分		2,297		183				
17	うち、内部格付手法準拠方式適用分	3,308		264					
	うち、外部格付準拠方式適用分		-		-				
18	うち、外部格付準拠方式又は内部評価方式適用分	-	-	-	-				
19	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	-	-	-	-				
20	マーケット・リスク	22,040	537	1,763	42				
21	うち、標準的方式適用分	-	537	-	42				
22	うち、内部モデル方式適用分	-	-	-	-				
	うち、簡易的方式適用分	22,040		1,763					
23	勘定間の振替分	-	-	-	-				
24	オペレーショナル・リスク	210,849	322,739	16,867	25,819				
	うち、基礎的手法適用分		56,226		4,498				
	うち、粗利益配分手法適用分		-		-				
	うち、先進的計測手法適用分		266,513		21,321				
25	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	12,829	5,489	1,026	458				
	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		-		-				
26	フロア調整	-	-	-	-				
27	合計	1,644,448	1,638,890	131,555	131,111				

注） 2023年12月末のリスク・アセットの合計は、スケーリング・ファクター勘案後の数値です。

みずほ信託銀行【連結】

2024年3月末

(単位：百万円)

CMS1：内部モデルを用いた手法と標準的手法のリスク・アセットの比較					
項番		イ	ロ	ハ	ニ
		リスク・アセットの額			
		内部モデルを用いて算出したリスク・アセットの額	標準的な手法適用分のリスク・アセットの額	リスク・アセットの額	資本フロア計算に用いられる、標準的な手法により算出したリスク・アセットの額（フロア掛目前）
1	信用リスク	837,551	189,747	1,027,298	2,083,506
2	カウンターパーティ信用リスク	572	693	1,266	1,267
3	CVAリスク		-	-	-
4	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	3,308	-	3,308	1,636
5	マーケット・リスク	-	22,040	22,040	22,040
6	オペレーショナル・リスク		210,849	210,849	210,849
7	その他リスク・アセット		379,684	379,684	232,350
8	合計	841,432	803,016	1,644,448	2,551,651

(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		11,078
2	当四半期中の要因別 の変動額	資産の規模	533
3		ポートフォリオの質	△ 163
4		モデルの更新	-
5		手法及び方針	△ 183
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		11,265

注) 1. 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起因するリスク・アセットの変動額です。

2. 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起因するリスク・アセットの変動額です。

3. 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。

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。