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【単体】
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	1,185,502	1,103,927	94,840	92,870
2	うち、標準的手法適用分	164,179	-	13,134	-
	うち、内部格付手法適用分	-	949,139	-	80,487
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	495,044	-	39,603	-
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	387,239	-	30,979	-
	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	139,038	154,788	11,123	12,383
6	カウンターパーティ信用リスク	4,019	3,275	321	274
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	3,448	2,688	275	227
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	-	123,706	-	10,490
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	150,041	-	12,003	-
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（マデント方式）	-	-	-	-
	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%）	-	-	-	-
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%）	740	14	59	1
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	22,038	90	1,763	7
21	うち、標準的方式適用分	-	90	-	7
22	うち、内部モデル方式適用分	-	-	-	-
	うち、簡易的方式適用分	22,038	-	1,763	-
23	勘定間の振替分	-	-	-	-
24	オペレーショナル・リスク	153,597	266,513	12,287	21,321
	うち、基礎的手法適用分	-	-	-	-
	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	7,722	810	617	68
	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	1,561,787	1,610,706	124,942	128,856

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