

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】  
2022年9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<br>該当番号   |                                                  | リスク・アセット  |           | 所要自己資本   |          |
|                 |                                                  | 2022年9月末  | 2022年6月末  | 2022年9月末 | 2022年6月末 |
| 1               | 信用リスク                                            | 1,164,064 | 1,205,686 | 98,052   | 101,583  |
| 2               | うち、標準的手法適用分                                      | -         | -         | -        | -        |
| 3               | うち、内部格付手法適用分                                     | 1,026,553 | 1,068,443 | 87,051   | 90,603   |
|                 | 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                                              | 137,510   | 137,243   | 11,000   | 10,979   |
| 4               | カウンターパーティ信用リスク                                   | 3,743     | 3,170     | 313      | 266      |
| 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                              | 845       | 455       | 67       | 36       |
|                 | その他                                              | 2,897     | 2,714     | 245      | 230      |
| 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                       | 128,582   | 118,163   | 10,903   | 10,020   |
| 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）      | 36,177    | 33,979    | 3,016    | 2,832    |
| 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%）      | -         | -         | -        | -        |
| 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%） | 9         | 12        | 0        | 0        |
| 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               | 659       | 674       | 52       | 53       |
| 13              | うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分                         | 659       | 674       | 52       | 53       |
| 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                                        | 135       | 240       | 10       | 19       |
| 17              | うち、標準的方式適用分                                      | 135       | 240       | 10       | 19       |
| 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                                     | 266,119   | 260,344   | 21,289   | 20,827   |
| 20              | うち、基礎的手法適用分                                      | -         | -         | -        | -        |
| 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                                    | 266,119   | 260,344   | 21,289   | 20,827   |
| 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                 | 16,108    | 16,595    | 1,295    | 1,334    |
|                 | 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                                            | 12,028    | 8,776     | 962      | 702      |
| 25              | 合計（スケーリング・ファクター勘案後）                              | 1,698,733 | 1,720,517 | 135,898  | 137,641  |