

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】  
2023年6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   |          |
|                  |  | 2023年6月末  | 2023年3月末  | 2023年6月末 | 2023年3月末 |
| 1                | 信用リスク  | 1,129,346 | 1,150,060 | 94,992   | 96,717   |
| 2                | うち、標準的手法適用分                                      | -         | -         | -        | -        |
| 3                | うち、内部格付手法適用分                                     | 967,620   | 981,869   | 82,054   | 83,262   |
|                  | 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  | 161,725   | 168,190   | 12,938   | 13,455   |
| 4                | カウンターパーティ信用リスク                                   | 3,438     | 3,558     | 289      | 297      |
| 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                            | -         | 1         | -        | 0        |
| 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                              | 475       | 899       | 38       | 71       |
|                  | その他  | 2,962     | 2,657     | 251      | 225      |
| 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                       | 113,226   | 144,759   | 9,601    | 12,275   |
| 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）      | 49,626    | 39,141    | 4,153    | 3,268    |
| 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（マンデート方式）        | -         | -         | -        | -        |
|                  | 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%） | 10        | 10        | 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               | 1,104     | 602       | 88       | 48       |
| 13               | うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分                         | 1,104     | 602       | 88       | 48       |
| 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  | 494       | 47        | 39       | 3        |
| 17               | うち、標準的方式適用分                                      | 494       | 47        | 39       | 3        |
| 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                                     | 272,185   | 271,713   | 21,774   | 21,737   |
| 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                                    | 272,185   | 271,713   | 21,774   | 21,737   |
| 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                 | 3,282     | 14,423    | 266      | 1,163    |
|                  | 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(スケールリング・ファクター勘案後)                             | 1,640,083 | 1,693,913 | 131,206  | 135,513  |