

**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6月末

(単位：百万円)

OV1: 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6月末	2024年3月末	2024年6月末	2024年3月末
1	信用リスク	1,126,014	1,174,531	90,081	93,962
2	うち、標準的手法適用分	188,448	189,747	15,075	15,179
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	463,686	491,524	37,094	39,321
4	うち、スロッシング・クライテリア適用分	-	-	-	-
5	うち、先進的内部格付手法適用分	333,711	346,026	26,696	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	140,167	147,233	11,213	11,778
6	カウンターパーティ信用リスク	1,280	1,266	102	101
7	うち、SA-CCR適用分	4	-	0	-
8	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	585	571	46	45
9	その他	690	695	55	55
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	-	-	-	-
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	177,782	181,579	14,222	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）	36,276	34,816	2,902	2,785
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（マンドレート方式）	-	-	-	-
	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%）	2,447	2,453	195	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%）	-	-	-	-
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%）	773	771	61	61
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	3,249	3,308	259	264
17	うち、内部格付手法準拠方式適用分	3,249	3,308	259	264
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	24,134	22,040	1,930	1,763
21	うち、標準的方式適用分	-	-	-	-
22	うち、内部モデル方式適用分	-	-	-	-
	うち、簡易的方式適用分	24,134	22,040	1,930	1,763
23	勘定間の振替分	-	-	-	-
24	オペレーショナル・リスク	210,849	210,849	16,867	16,867
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	11,668	12,829	933	1,026
26	フロア調整	-	-	-	-
27	合計	1,594,476	1,644,448	127,558	131,555

みずほ信託銀行【連結】

2024年6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	797,397	188,448	985,846	2,021,576
2	カウンターパーティ信用リスク	594	686	1,280	1,293
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	3,249	-	3,249	1,304
5	マーケット・リスク	-	24,134	24,134	24,134
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		369,115	369,115	224,531
8	合計	801,241	793,235	1,594,476	2,483,690

みずほ信託銀行【連結】  
2024年6月末

(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	11,265	
2	当四半期中の要因別の変動額	資産の規模	△ 534
3		ポートフォリオの質	103
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	1
8		その他	-
9	当四半期末時点における信用リスク・アセットの額	10,836	

- 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に起因するリスク・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に起因するリスク・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。