

**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】

2025年3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	
		2025年3月末	2024年12月末	2025年3月末	2024年12月末
1	信用リスク	1,066,677	1,069,258	85,334	85,540
2	うち、標準的手法適用分	224,523	181,133	17,961	14,490
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	435,674	440,420	34,853	35,233
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	271,559	307,480	21,724	24,598
	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	134,920	140,224	10,793	11,217
6	カウンターパーティ信用リスク	1,202	1,331	96	106
7	うち、SA-CCR適用分	-	-	-	-
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	533	565	42	45
9	その他	669	765	53	61
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	188,966	162,422	15,117	12,993
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）	35,205	36,095	2,816	2,887
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%）	4,948	4,947	395	395
	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%）	1,916	1,606	153	128
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	3,094	3,196	247	255
17	うち、内部格付手法準拠方式適用分	3,094	3,196	247	255
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	22,598	25,258	1,807	2,020
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	22,598	25,258	1,807	2,020
23	勘定間の振替分	-	-	-	-
24	オペレーショナル・リスク	224,189	214,670	17,935	17,173
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	13,781	12,012	1,102	961
26	フロア調整	-	-	-	-
27	合計	1,562,582	1,530,800	125,006	122,464

みずほ信託銀行【連結】

2025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	707,233	224,523	931,757	1,740,090
2	カウンターパーティ信用リスク	533	669	1,202	1,202
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	3,094	-	3,094	1,233
5	マーケット・リスク	-	22,598	22,598	22,598
6	オペレーショナル・リスク		224,189	224,189	224,189
7	その他リスク・アセット		379,739	379,739	243,009
8	合計	710,862	851,720	1,562,582	2,232,324