

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9月末

(単位：百万円)

OV1: リスク・アセットの概要					
国際様式の 該当番号		イ	ロ	ハ	ニ
		リスク・アセット		所要自己資本	
		2025年9月末	2025年6月末	2025年9月末	2025年6月末
1	信用リスク	1,070,140	1,054,671	85,611	84,373
2	うち、標準的手法適用分	258,380	225,913	20,670	18,073
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	434,592	439,007	34,767	35,120
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	249,357	260,491	19,948	20,839
	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	127,809	129,259	10,224	10,340
6	カウンターパーティ信用リスク	1,246	1,212	99	97
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	531	536	42	42
9	その他	714	676	57	54
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	204,031	197,797	16,322	15,823
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）	43,437	34,816	3,474	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%）	4,889	4,946	391	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%）	848	806	67	64
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	3,236	3,252	258	260
17	うち、内部格付手法準拠方式適用分	3,236	3,252	258	260
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	23,098	22,287	1,847	1,782
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	23,098	22,287	1,847	1,782
23	勘定間の振替分	-	-	-	-
24	オペレーショナル・リスク	226,006	224,189	18,080	17,935
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	12,727	11,775	1,018	942
26	フロア調整	-	-	-	-
27	合計	1,589,661	1,555,756	127,172	124,460

みずほ信託銀行【連結】

2025年9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	683,950	258,380	942,330	1,747,241
2	カウンターパーティ信用リスク	535	710	1,246	1,251
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	3,236	-	3,236	1,261
5	マーケット・リスク	-	23,098	23,098	23,098
6	オペレーショナル・リスク		226,006	226,006	226,006
7	その他リスク・アセット		393,743	393,743	247,288
8	合計	687,722	901,938	1,589,661	2,246,147