

## みずほ信託銀行連結の主要な指標

バーゼル銀行監督委員会の合意に基づく自己資本比率規制では、自己資本比率等の最低水準を充足することが求められています。

当行は、「銀行法第14条の2の規定に基づき、銀行がその保有する資産等に照らし自己資本の充実の状況が適当であるかどうかを判断するための基準」（平成18年金融庁告示第19号）に基づき、連結自己資本比率を算出しています。

また、当行は、「銀行法第14条の2の規定に基づき、銀行がその保有する資産等に照らし自己資本の充実の状況が適当であるかどうかを判断するための基準の補完的指標として定めるレバレッジに係る健全性を判断するための基準」（平成31年金融庁告示第11号）に基づき、連結レバレッジ比率を算出しています。

バーゼル銀行監督委員会の合意に基づく流動性比率規制では、流動性カバレッジ比率及び安定調達比率の最低水準を充足することが求められています。当行は、「銀行法第14条の2の規定に基づき、銀行がその経営の健全性を判断するための基準として定める流動性に係る健全性を判断するための基準」（平成26年金融庁告示第60号、以下「告示第60号」）に基づき、連結流動性カバレッジ比率（以下「連結LCR」）及び連結安定調達比率（以下「連結NSFR」）を算出しています。

### ■主要な指標

#### KM1：主要な指標

(単位：百万円、%)

国際様式の 該当番号		イ	ロ	ハ	ニ	ホ
		2022年度 第4四半期末	2022年度 第3四半期末	2022年度 第2四半期末	2022年度 第1四半期末	2021年度 第4四半期末
資本						
1	普通株式等Tier 1資本の額	444,732	464,879	453,330	445,224	442,413
2	Tier 1資本の額	444,748	464,893	453,345	445,238	442,428
3	総自己資本の額	444,929	464,953	453,401	445,290	442,500
リスク・アセット						
4	リスク・アセットの額	1,714,312	1,656,826	1,702,856	1,764,666	1,756,972
自己資本比率						
5	連結普通株式等Tier 1比率	25.94%	28.05%	26.62%	25.22%	25.18%
6	連結Tier 1比率	25.94%	28.05%	26.62%	25.23%	25.18%
7	連結総自己資本比率	25.95%	28.06%	26.62%	25.23%	25.18%
連結レバレッジ比率						
13	総エクスポージャーの額	4,191,401	4,326,112	4,290,626	4,496,974	4,336,920
14	連結レバレッジ比率	10.61%	10.74%	10.56%	9.90%	10.20%
連結流動性カバレッジ比率						
15	算入可能適格流動性資産の合計額	2,704,014	2,283,165	2,282,828	2,014,599	1,859,501
16	純資金流出額	2,112,520	1,792,827	1,667,339	1,468,472	1,293,331
17	連結流動性カバレッジ比率	128.1%	128.2%	138.1%	138.2%	145.5%
連結安定調達比率						
18	利用可能安定調達額	3,534,899	3,492,895	3,528,155	3,617,995	3,569,677
19	所要安定調達額	3,069,023	3,131,223	3,115,172	3,270,115	3,157,361
20	連結安定調達比率	115.1%	111.5%	113.2%	110.6%	113.0%

注) 項番15～17には四半期平均値を記載しています。

## みずほ信託銀行連結の自己資本の充実の状況

「銀行法施行規則第19条の2第1項第5号二等の規定に基づき、自己資本の充実の状況等について金融庁長官が別に定める事項」(平成26年金融庁告示第7号)に基づき開示しています。

定性的な開示事項のうちグループ共通の事項については、みずほフィナンシャルグループの「連結の自己資本の充実の状況」にて包括して記載しています。

### ■ 連結の範囲

#### (1) 連結自己資本比率の算出における連結の範囲

##### (A) 連結財務諸表規則に基づき連結の範囲(以下「会計連結範囲」)に含まれる会社との相違点

2021年度、2022年度とも、該当ありません。

##### (B) 連結子会社の数

	2021年度	2022年度
連結子会社	11社	12社

主要な連結子会社は、みずほ不動産販売株式会社、Mizuho Trust & Banking (Luxembourg) S.A.、みずほリアルティOne株式会社です。

各連結子会社の主要な業務の内容については、67～73ページをご覧ください。

##### (C) 自己資本比率告示第9条が適用される金融業務を営む関連法人等

2021年度、2022年度とも、該当ありません。

##### (D) 連結グループに属する会社であって会計連結範囲に含まれないもの及び連結グループに属しない会社であって会計連結範囲に含まれるもの

2021年度、2022年度とも、該当ありません。

##### (E) 連結グループ内の資金及び自己資本の移動に係る制限等

2021年度、2022年度とも、該当ありません。

##### (F) その他金融機関等であって銀行の子法人等であるもののうち、規制上の所要自己資本を下回った会社

2021年度、2022年度とも、該当ありません。

## ■自己資本

### (1) 自己資本の構成等

#### (A) CC1：自己資本の構成

(単位：百万円、%)

国際様式の 該当番号	項目	イ 2021年度	ロ 2022年度	ハ 別紙様式第十四号 (CC2)の参照項目
普通株式等Tier1資本に係る基礎項目 (1)				
1a+2-1c-26	普通株式に係る株主資本の額	453,991	453,991	
1a	うち資本金及び資本剰余金の額	265,195	265,195	
2	うち利益剰余金の額	316,764	299,933	
1c	うち自己株式の額(△)	79,999	79,999	
26	うち社外流出予定額(△)	47,968	31,137	
	うち上記以外に該当するものの額	—	—	
1b	普通株式に係る新株予約権の額	—	—	
3	その他の包括利益累計額及びその他公表準備金の額	81,382	109,433	(a)
5	普通株式等Tier1資本に係る調整後非支配株主持分の額	—	—	
6	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額 (イ)	535,373	563,424	
普通株式等Tier1資本に係る調整項目 (2)				
8+9	無形固定資産(モーゲージ・サービシング・ライツに係るものを除く。)の額の合計額	27,629	25,272	
8	うちのれんに係るもの(のれん相当差額を含む。)の額	11,594	10,727	
9	うちのれん及びモーゲージ・サービシング・ライツに係るもの以外のものの額	16,034	14,544	
10	繰延税金資産(一時差異に係るものを除く。)の額	—	—	
11	繰延ヘッジ損益の額	△246	4,642	
12	適格引当金不足額	1,540	1,293	
13	証券化取引に伴い増加した自己資本に相当する額	—	—	
14	負債の時価評価により生じた時価評価差額であって自己資本に算入される額	—	—	
15	退職給付に係る資産の額	64,036	87,485	
16	自己保有普通株式(純資産の部に計上されるものを除く。)の額	—	—	
17	意図的に保有している他の金融機関等の普通株式の額	—	—	
18	少数出資金融機関等の普通株式の額	—	—	
19+20+21	特定項目に係る10%基準超過額	—	—	
19	うちその他金融機関等に係る対象資本等調達手段のうち普通株式に該当するものに関連するものの額	—	—	
20	うち無形固定資産(モーゲージ・サービシング・ライツに係るものに限る。)に関連するものの額	—	—	
21	うち繰延税金資産(一時差異に係るものに限る。)に関連するものの額	—	—	
22	特定項目に係る15%基準超過額	—	—	
23	うちその他金融機関等に係る対象資本等調達手段のうち普通株式に該当するものに関連するものの額	—	—	
24	うち無形固定資産(モーゲージ・サービシング・ライツに係るものに限る。)に関連するものの額	—	—	
25	うち繰延税金資産(一時差異に係るものに限る。)に関連するものの額	—	—	
27	その他Tier1資本不足額	—	—	
28	普通株式等Tier1資本に係る調整項目の額 (ロ)	92,960	118,692	
普通株式等Tier1資本				
29	普通株式等Tier1資本の額((イ)-(ロ)) (ハ)	442,413	444,732	

(次ページへ続く)

## みずほ信託銀行連結の自己資本の充実の状況

(続き)

(単位：百万円、%)

国際様式の 該当番号	項目		イ 2021年度	ロ 2022年度	ハ 別紙様式第十四号 (CC2)の参照項目
<b>その他Tier1資本に係る基礎項目</b>		(3)			
30 31a	その他Tier1資本調達手段に係る株主資本の額及びその内訳		—	—	
30 31b	その他Tier1資本調達手段に係る新株予約権の額		—	—	
30 32	その他Tier1資本調達手段に係る負債の額		—	—	
30	特別目的会社等の発行するその他Tier1資本調達手段の額		—	—	
34-35	その他Tier1資本に係る調整後非支配株主持分等の額		14	15	
33+35	適格旧Tier1資本調達手段の額のうちその他Tier1資本に係る基礎項目の額に含まれる額		/	/	
33	うち銀行及び銀行の特別目的会社等の発行する資本調達手段の額		/	/	
35	うち銀行の連結子法人等(銀行の特別目的会社等を除く。)の発行する資本調達手段の額		/	/	
36	その他Tier1資本に係る基礎項目の額	(二)	14	15	
<b>その他Tier1資本に係る調整項目</b>					
37	自己保有その他Tier1資本調達手段の額		—	—	
38	意図的に保有している他の金融機関等のその他Tier1資本調達手段の額		—	—	
39	少数出資金融機関等のその他Tier1資本調達手段の額		—	—	
40	その他金融機関等のその他Tier1資本調達手段の額		—	—	
42	Tier2資本不足額		—	—	
43	その他Tier1資本に係る調整項目の額	(ホ)	—	—	
<b>その他Tier1資本</b>					
44	その他Tier1資本の額((二)-(ホ))	(ヘ)	14	15	
<b>Tier1資本</b>					
45	Tier1資本の額((ハ)+(ヘ))	(ト)	442,428	444,748	
<b>Tier2資本に係る基礎項目</b>		(4)			
46	Tier2資本調達手段に係る株主資本の額及びその内訳		—	—	
46	Tier2資本調達手段に係る新株予約権の額		—	—	
46	Tier2資本調達手段に係る負債の額		—	—	
46	特別目的会社等の発行するTier2資本調達手段の額		—	—	
48-49	Tier2資本に係る調整後非支配株主持分等の額		3	3	
47+49	適格旧Tier2資本調達手段の額のうちTier2資本に係る基礎項目の額に含まれる額		/	/	
47	うち銀行及び銀行の特別目的会社等の発行する資本調達手段の額		/	/	
49	うち銀行の連結子法人等(銀行の特別目的会社等を除く。)の発行する資本調達手段の額		/	/	
50	一般貸倒引当金Tier2算入額及び適格引当金Tier2算入額の合計額		68	177	
50a	うち一般貸倒引当金Tier2算入額		68	177	
50b	うち適格引当金Tier2算入額		—	—	
51	Tier2資本に係る基礎項目の額	(チ)	72	181	

(次ページへ続く)

(続き)

(単位：百万円、%)

国際様式の 該当番号	項目		イ 2021年度	ロ 2022年度	ハ 別紙様式第十四号 (CC2)の参照項目
<b>Tier2資本に係る調整項目</b>		(5)			
52	自己保有Tier2資本調達手段の額		—	—	
53	意図的に保有している他の金融機関等のTier2資本調達手段及びその他外部TLAC関連調達手段の額		—	—	
54	少数出資金融機関等のTier2資本調達手段及びその他外部TLAC関連調達手段の額		—	—	
55	その他金融機関等のTier2資本調達手段及びその他外部TLAC関連調達手段の額		—	—	
57	Tier2資本に係る調整項目の額	(リ)	—	—	
<b>Tier2資本</b>					
58	Tier2資本の額((チ)-(リ))	(ヌ)	72	181	
<b>総自己資本</b>					
59	総自己資本の額((ト)+(ヌ))	(ル)	442,500	444,929	
<b>リスク・アセット</b>		(6)			
60	リスク・アセットの額	(ヲ)	1,756,972	1,714,312	
<b>連結自己資本比率</b>		(7)			
61	連結普通株式等Tier1比率((ハ)/(ヲ))		25.18%	25.94%	
62	連結Tier1比率((ト)/(ヲ))		25.18%	25.94%	
63	連結総自己資本比率((ル)/(ヲ))		25.18%	25.95%	
<b>調整項目に係る参考事項</b>		(8)			
72	少数出資金融機関等の対象資本等調達手段に係る調整項目不算入額		7,640	8,028	
73	その他金融機関等に係る対象資本等調達手段のうち普通株式に係る調整項目不算入額		1,828	2,104	
74	無形固定資産(モーゲージ・サービシング・ライツに係るものに限る。)に係る調整項目不算入額		—	—	
75	繰延税金資産(一時差異に係るものに限る。)に係る調整項目不算入額		7,763	5,459	
<b>Tier2資本に係る基礎項目の額に算入される引当金に関する事項</b>		(9)			
76	一般貸倒引当金の額		68	177	
77	一般貸倒引当金に係るTier2資本算入上限額		964	1,289	
78	内部格付手法採用行において、適格引当金の合計額から事業法人等向けエクスポージャー及びリテール向けエクスポージャーの期待損失額の合計額を控除した額(当該額が零を下回る場合にあっては、零とする。)		—	—	
79	適格引当金に係るTier2資本算入上限額		8,205	7,695	
<b>資本調達手段に係る経過措置に関する事項</b>		(10)			
82	適格旧Tier1資本調達手段に係る算入上限額		/	/	
83	適格旧Tier1資本調達手段の額から適格旧Tier1資本調達手段に係る算入上限額を控除した額(当該額が零を下回る場合にあっては、零とする。)		/	/	
84	適格旧Tier2資本調達手段に係る算入上限額		/	/	
85	適格旧Tier2資本調達手段の額から適格旧Tier2資本調達手段に係る算入上限額を控除した額(当該額が零を下回る場合にあっては、零とする。)		/	/	

注) 1. 上記は「銀行法第14条の2の規定に基づき、銀行がその保有する資産等に照らし自己資本の充実の状況が適当であるかどうかを判断するための基準」(平成18年金融庁告示第19号。以下、「告示」という。)に基づいて算出したものであり、国際統一基準を採用した連結ベースの計数となっています。

2. 当行は、連結自己資本比率の算定に関する外部監査として、日本公認会計士協会専門業務実務指針4465「自己資本比率及びレバレッジ比率の算定に対する合意された手続業務に関する実務指針」に基づく合意された手続業務を、EY新日本有限責任監査法人により受けています。なお、当該業務は、連結財務諸表の監査又は財務報告に係る内部統制の監査の一部ではありません。当該業務は自己資本比率そのものや自己資本比率の算定に係る内部管理体制について意見又は結論を表明するものではなく、当行と合意した範囲において手続をEY新日本有限責任監査法人が実施し、当行に対しその結果を報告するものです。

## みずほ信託銀行連結の自己資本の充実の状況

## (B) CC2：連結貸借対照表の科目と自己資本の構成に関する開示項目の対応関係

(単位：百万円)

項目	イ	ロ	ハ	ニ
	公表 連結貸借対照表 2021年度	公表 連結貸借対照表 2022年度		
<b>(資産の部)</b>				
現金預け金	2,059,108	2,820,307		
債券貸借取引支払保証金	20,046	20,177		
買入金銭債権	35,314	32,261		
金銭の信託	26,556	27,418		
有価証券	287,400	260,751		2-b, 6-b
貸出金	3,181,420	3,054,766		6-c
外国為替	2,958	4,422		
その他資産	264,215	290,010		6-d
有形固定資産	100,851	101,802		
無形固定資産	34,354	31,152		2-a
退職給付に係る資産	92,298	126,096		3
繰延税金資産	573	863		4-a
支払承諾見返	14,109	13,655		
貸倒引当金	△2,912	△3,662		
<b>資産の部合計</b>	<b>6,116,295</b>	<b>6,780,023</b>		
<b>(負債の部)</b>				
預金	2,681,369	2,875,774		
譲渡性預金	691,880	470,180		
コールマネー及び売渡手形	603,990	907,935		
借入金	300,000	303,400		8-a
信託勘定借	1,167,284	1,534,097		
その他負債	36,236	33,184		6-f
賞与引当金	4,406	5,046		
変動報酬引当金	272	245		
退職給付に係る負債	1,065	1,097		
役員退職慰労引当金	191	141		
睡眠預金払戻損失引当金	992	714		
移転損失引当金	3,061	—		
繰延税金負債	28,023	39,895		4-b
支払承諾	14,109	13,655		
<b>負債の部合計</b>	<b>5,532,883</b>	<b>6,185,368</b>		
<b>(純資産の部)</b>				
資本金	247,369	247,369		1-a
資本剰余金	17,825	17,825		1-b
利益剰余金	316,764	299,933		1-c
自己株式	△79,999	△79,999		1-d
<b>株主資本合計</b>	<b>501,959</b>	<b>485,128</b>		
その他有価証券評価差額金	58,707	61,505		
繰延ヘッジ損益	△246	4,642		5
為替換算調整勘定	1,672	3,523		
退職給付に係る調整累計額	21,248	39,762		
<b>その他の包括利益累計額合計</b>	<b>81,382</b>	<b>109,433</b>	(a)	
<b>非支配株主持分</b>	<b>70</b>	<b>93</b>		7
<b>純資産の部合計</b>	<b>583,411</b>	<b>594,655</b>		
<b>負債及び純資産の部合計</b>	<b>6,116,295</b>	<b>6,780,023</b>		

注) 規制上の連結の範囲と会計上の連結の範囲は同一であります。

〈付表〉

1. 株主資本

①連結貸借対照表

(単位：百万円)

参照番号	連結貸借対照表科目	2021年度	2022年度	備考
1-a	資本金	247,369	247,369	
1-b	資本剰余金	17,825	17,825	
1-c	利益剰余金	316,764	299,933	
1-d	自己株式	△79,999	△79,999	
	<b>株主資本合計</b>	<b>501,959</b>	<b>485,128</b>	

②自己資本の構成

(単位：百万円)

国際様式の 該当番号	自己資本の構成に関する開示事項	2021年度	2022年度	備考
	普通株式等Tier1資本に係る額	501,959	485,128	普通株式に係る株主資本(社外流出予定額調整前)
1a	うち資本金及び資本剰余金の額	265,195	265,195	
2	うち利益剰余金の額	316,764	299,933	
1c	うち自己株式の額(△)	79,999	79,999	
	うち上記以外に該当するものの額	—	—	
31a	その他Tier1資本調達手段に係る額	—	—	

2. 無形固定資産

①連結貸借対照表

(単位：百万円)

参照番号	連結貸借対照表科目	2021年度	2022年度	備考
2-a	無形固定資産	34,354	31,152	
2-b	有価証券	287,400	260,751	
	うち持分法適用会社に係るのれん相当額	—	—	持分法適用会社に係るのれん相当額
	上記に係る税効果	△6,724	△5,880	

②自己資本の構成

(単位：百万円)

国際様式の 該当番号	自己資本の構成に関する開示事項	2021年度	2022年度	備考
8	無形固定資産 のれんに係るもの	11,594	10,727	
9	無形固定資産 その他の無形固定資産	16,034	14,544	のれん、モーゲージ・サービシング・ライセンス以外(ソフトウェア等)
	無形固定資産 モーゲージ・サービシング・ライセンス	—	—	
20	特定項目に係る10%基準超過額	—	—	
24	特定項目に係る15%基準超過額	—	—	
74	無形固定資産(モーゲージ・サービシング・ライセンスに係るものに限る。)に係る調整項目不算入額	—	—	

みずほ信託銀行連結の自己資本の充実の状況

3. 退職給付に係る資産

①連結貸借対照表

(単位：百万円)

参照番号	連結貸借対照表科目	2021年度	2022年度	備考
3	退職給付に係る資産	92,298	126,096	
	上記に係る税効果	△28,261	△38,610	

②自己資本の構成

(単位：百万円)

国際様式の 該当番号	自己資本の構成に関する開示事項	2021年度	2022年度	備考
15	退職給付に係る資産の額	64,036	87,485	

4. 繰延税金資産

①連結貸借対照表

(単位：百万円)

参照番号	連結貸借対照表科目	2021年度	2022年度	備考
4-a	繰延税金資産	573	863	
4-b	繰延税金負債	28,023	39,895	
	無形固定資産の税効果勘案分	6,724	5,880	
	退職給付に係る資産の税効果勘案分	28,261	38,610	

②自己資本の構成

(単位：百万円)

国際様式の 該当番号	自己資本の構成に関する開示事項	2021年度	2022年度	備考
10	繰延税金資産(一時差異に係るものを除く。)	—	—	資産負債相殺処理等のため、連結貸借対照表計上額とは一致せず
	一時差異に係る繰延税金資産	7,763	5,459	資産負債相殺処理等のため、連結貸借対照表計上額とは一致せず
21	特定項目に係る10%基準超過額	—	—	
25	特定項目に係る15%基準超過額	—	—	
75	繰延税金資産(一時差異に係るものに限る。)に係る調整項目不算入額	7,763	5,459	

5. 繰延ヘッジ損益

①連結貸借対照表

(単位：百万円)

参照番号	連結貸借対照表科目	2021年度	2022年度	備考
5	繰延ヘッジ損益	△246	4,642	

②自己資本の構成

(単位：百万円)

国際様式の 該当番号	自己資本の構成に関する開示事項	2021年度	2022年度	備考
11	繰延ヘッジ損益の額	△246	4,642	ヘッジ対象に係る時価評価差額が「その他の包括利益累計額合計」として計上されているものを除いたもの

## 6. 金融機関向け出資等の対象科目

### ①連結貸借対照表

(単位：百万円)

参照番号	連結貸借対照表科目	2021年度	2022年度	備考
	特定取引資産	—	—	
6-b	有価証券	287,400	260,751	
6-c	貸出金	3,181,420	3,054,766	
6-d	その他資産	264,215	290,010	金融派生商品、出資金等を含む
	特定取引負債	—	—	
6-f	その他負債	36,236	33,184	金融派生商品等を含む

### ②自己資本の構成

(単位：百万円)

国際様式の 該当番号	自己資本の構成に関する開示事項	2021年度	2022年度	備考
	自己保有資本調達手段の額	—	—	
16	普通株式等Tier1相当額	—	—	
37	その他Tier1相当額	—	—	
52	Tier2相当額	—	—	
	意図的に保有している他の金融機関等の資本 調達手段の額	—	—	
17	普通株式等Tier1相当額	—	—	
38	その他Tier1相当額	—	—	
53	Tier2相当額及びその他外部TLAC関連調達 手段の額	—	—	
	少数出資金融機関等の資本調達手段の額	7,640	8,028	
18	普通株式等Tier1相当額	—	—	
39	その他Tier1相当額	—	—	
54	Tier2相当額及びその他外部TLAC関連調達 手段の額	—	—	
72	少数出資金融機関等の対象資本等調達手段 に係る調整項目不算入額	7,640	8,028	
	その他金融機関等(10%超出資)	1,828	2,104	
19	特定項目に係る10%基準超過額	—	—	
23	特定項目に係る15%基準超過額	—	—	
40	その他Tier1相当額	—	—	
55	Tier2相当額及びその他外部TLAC関連調達 手段の額	—	—	
73	その他金融機関等に係る対象資本等調達手 段のうち普通株式に係る調整項目不算入額	1,828	2,104	

## 7. 非支配株主持分

### ①連結貸借対照表

(単位：百万円)

参照番号	連結貸借対照表科目	2021年度	2022年度	備考
7	非支配株主持分	70	93	

### ②自己資本の構成

(単位：百万円)

国際様式の 該当番号	自己資本の構成に関する開示事項	2021年度	2022年度	備考
5	普通株式等Tier1資本に係る額	—	—	算入可能額(調整後非支配株主持分)勘案後
30-31ab-32	特別目的会社等の発行するその他Tier1資本 調達手段の額	—	—	算入可能額(調整後非支配株主持分)勘案後
34-35	その他Tier1資本に係る額	14	15	算入可能額(調整後非支配株主持分)勘案後
46	特別目的会社等の発行するTier2資本調達手 段の額	—	—	算入可能額(調整後非支配株主持分)勘案後
48-49	Tier2資本に係る額	3	3	算入可能額(調整後非支配株主持分)勘案後

## みずほ信託銀行連結の自己資本の充実の状況

## 8. その他資本調達

## ① 連結貸借対照表

(単位：百万円)

参照番号	連結貸借対照表科目	2021年度	2022年度	備考
8-a	借入金	300,000	303,400	
	社債	—	—	
	合計	300,000	303,400	

## ② 自己資本の構成

(単位：百万円)

国際様式の 該当番号	自己資本の構成に関する開示事項	2021年度	2022年度	備考
32	その他Tier1 資本調達手段に係る負債の額	—	—	
46	Tier2資本調達手段に係る負債の額	—	—	

## ■リスク・アセットの概要

### (A) OV1：リスク・アセットの概要

(単位：百万円)

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			
		2022年度	2021年度	2022年度	2021年度	2022年度	2021年度	2022年度	2021年度
1	信用リスク	1,092,211	1,170,651	91,663	98,389				
2	うち、標準的手法適用分	22,095	26,397	1,767	2,111				
3	うち、内部格付手法適用分	893,043	986,920	75,730	83,690				
	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	177,072	157,333	14,165	12,586				
4	カウンターパーティ信用リスク	910	314	72	25				
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	0	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	899	309	71	24				
	その他	9	4	0	0				
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	163,433	140,574	13,859	11,920				
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）	39,141	33,918	3,268	2,827				
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%）	3,011	2,840	255	240				
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%）	2,827	2,499	226	199				
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	602	717	48	57				
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	602	717	48	57				
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	3,359	3,080	268	246				
17	うち、標準的方式適用分	3,359	3,080	268	246				
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	324,300	308,881	25,944	24,710				
20	うち、基礎的手法適用分	52,587	48,792	4,207	3,903				
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	271,713	260,088	21,737	20,807				
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	18,911	23,979	1,538	1,940				
	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（スケーリング・ファクター勘案後）	1,714,312	1,756,972	137,145	140,557				

みずほ信託銀行連結の自己資本の充実の状況

■財務諸表と規制上のエクスポージャーとの間の対応関係

(A) LI1：会計上の連結範囲と自己資本比率規制上の連結範囲との間の差異及び連結貸借対照表の区分と自己資本比率規制上のリスク・カテゴリーとの対応関係

(単位：百万円)

	2021年度						
	イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ	ト
	連結貸借対照表計上額	自己資本比率規制上の連結範囲に基づく連結貸借対照表計上額	各項目に対応する帳簿価額				所要自己資本算定対象外の項目又は規制資本からの調整項目
		信用リスク (二欄及びホ欄に該当する額を除く。)	カウンターパーティ信用リスク	証券化エクスポージャー (ヘ欄に該当する額を除く。)	マーケット・リスク		
<b>資産</b>							
現金預け金	2,059,108		2,059,108	—	—	—	—
債券貸借取引支払保証金	20,046		—	20,046	—	—	—
買入金銭債権	35,314		32,068	—	3,047	—	198
金銭の信託	26,556		26,556	—	—	—	—
有価証券	287,400		287,400	—	—	—	—
貸出金	3,181,420		3,179,920	—	1,500	—	—
外国為替	2,958		2,958	—	—	—	—
その他資産	264,215		174,660	89,555	—	—	—
有形固定資産	100,851		100,851	—	—	—	—
無形固定資産	34,354		6,995	—	—	—	27,358
退職給付に係る資産	92,298		28,261	—	—	—	64,036
繰延税金資産	573		573	—	—	—	—
支払承諾見返	14,109		14,109	—	—	—	—
貸倒引当金	△2,912		△2,913	—	—	—	0
<b>資産合計</b>	<b>6,116,295</b>		<b>5,910,551</b>	<b>109,601</b>	<b>4,547</b>	<b>—</b>	<b>91,594</b>
<b>負債</b>							
預金	2,681,369		—	—	—	—	2,681,369
譲渡性預金	691,880		—	—	—	—	691,880
コールマネー及び売渡手形	603,990		—	—	—	—	603,990
借入金	300,000		—	—	—	—	300,000
信託勘定借	1,167,284		—	—	—	—	1,167,284
その他負債	36,236		—	888	—	—	35,347
賞与引当金	4,406		—	—	—	—	4,406
変動報酬引当金	272		—	—	—	—	272
退職給付に係る負債	1,065		—	—	—	—	1,065
役員退職慰労引当金	191		—	—	—	—	191
睡眠預金払戻損失引当金	992		—	—	—	—	992
移転損失引当金	3,061		—	—	—	—	3,061
繰延税金負債	28,023		—	—	—	—	28,023
支払承諾	14,109		—	—	—	—	14,109
<b>負債合計</b>	<b>5,532,883</b>		<b>—</b>	<b>888</b>	<b>—</b>	<b>—</b>	<b>5,531,995</b>

注) 1. 会計上の連結範囲と自己資本比率規制上の連結範囲が同一であるため、イ及びロ欄を統合しています。  
2. マーケット・リスクは、銀行勘定の為替リスクやコモディティリスクも含まれますが、特定取引勘定の科目のみ計上しています。

(単位：百万円)

	2022年度						
	イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ	ト
	連結貸借対照表計上額	自己資本比率規制上の連結範囲に基づく連結貸借対照表計上額	各項目に対応する帳簿価額				
		信用リスク (二欄及びホ欄に該当する額を除く。)	カウンターパーティ信用リスク	証券化エクスポージャー (ヘ欄に該当する額を除く。)	マーケット・リスク	所要自己資本算定対象外の項目又は規制資本からの調整項目	
<b>資産</b>							
現金預け金	2,820,307		2,820,307	—	—	—	
債券貸借取引支払保証金	20,177		—	20,177	—	—	
買入金銭債権	32,261		29,571	—	2,515	174	
金銭の信託	27,418		27,418	—	—	—	
有価証券	260,751		260,751	—	—	—	
貸出金	3,054,766		3,053,266	—	1,500	—	
外国為替	4,422		4,422	—	—	—	
その他資産	290,010		169,006	121,003	—	—	
有形固定資産	101,802		101,802	—	—	—	
無形固定資産	31,152		6,108	—	—	25,044	
退職給付に係る資産	126,096		38,610	—	—	87,485	
繰延税金資産	863		863	—	—	—	
支払承諾見返	13,655		13,655	—	—	—	
貸倒引当金	△3,662		△3,663	—	—	1	
<b>資産合計</b>	<b>6,780,023</b>		<b>6,522,120</b>	<b>141,181</b>	<b>4,015</b>	<b>112,705</b>	
<b>負債</b>							
預金	2,875,774		—	—	—	2,875,774	
譲渡性預金	470,180		—	—	—	470,180	
コールマネー及び売渡手形	907,935		—	—	—	907,935	
借入金	303,400		—	—	—	303,400	
信託勘定借	1,534,097		—	—	—	1,534,097	
その他負債	33,184		—	7,748	—	25,435	
賞与引当金	5,046		—	—	—	5,046	
変動報酬引当金	245		—	—	—	245	
退職給付に係る負債	1,097		—	—	—	1,097	
役員退職慰労引当金	141		—	—	—	141	
睡眠預金払戻損失引当金	714		—	—	—	714	
繰延税金負債	39,895		—	—	—	39,895	
支払承諾	13,655		—	—	—	13,655	
<b>負債合計</b>	<b>6,185,368</b>		—	<b>7,748</b>	—	<b>6,177,619</b>	

注) 1. 会計上の連結範囲と自己資本比率規制上の連結範囲が同一であるため、イ及びロ欄を統合しています。

2. マーケット・リスクは、銀行勘定の為替リスクやコモディティリスクも含まれますが、特定取引勘定の科目のみ計上しています。

みずほ信託銀行連結の自己資本の充実の状況

(B) LI2：自己資本比率規制上のエクスポージャーの額と連結貸借対照表計上額との差異の主な要因 (単位：百万円)

項番		2021年度					
		合計	イ	ロ	ハ	ニ	ホ
			対応する項目				
			信用リスク(ハ欄及びニ欄に該当する額を除く。)	カウンターパーティ信用リスク	証券化エクスポージャー(ホ欄に該当する額を除く。)	マーケット・リスク	
1	自己資本比率規制上の連結範囲に基づく資産の額	6,024,701	5,910,551	109,601	4,547	—	
2	自己資本比率規制上の連結範囲に基づく負債の額	888	—	888	—	—	
3	自己資本比率規制上の連結範囲に基づく資産及び負債の純額	6,023,812	5,910,551	108,713	4,547	—	
4	オフ・バランスシートの額	339,187	339,187	—	—	—	
5	引当て及び償却を勘案することによる差異	3,198	3,198	—	—	—	
6	デリバティブ取引等による差異	△73,178	—	△73,178	—	—	
7	レボ形式の取引による差異	99,495	—	99,495	—	—	
8	その他の差異	△15,406	△15,406	—	—	—	
9	自己資本比率規制上のエクスポージャーの額	6,377,108	6,237,530	135,029	4,547	—	

注) 1. 複数のリスク・カテゴリーで資本賦課の対象となるエクスポージャーが存在するため、イ欄は口欄からホ欄までの合計と一致しない場合があります。  
 2. 自己資本比率規制上のエクスポージャーの額と連結貸借対照表計上額との差異及びその要因に関する説明は以下の通りです。  
 ・ オフ・バランスシートの額は、主に、コミットメントラインの未引出額に係るエクスポージャーを加算したこと、支払承諾見返に自己資本比率規制上のオフ・バランス項目に適用される掛目を乗じたことによる差異です。  
 ・ 引当て及び償却を勘案することによる差異は、主に、内部格付手法対象の資産につき、貸倒引当金・部分直接償却等を調整したことによるものです。  
 ・ デリバティブ取引等による差異は、主に、規制上のエクスポージャーに将来の時価変動を反映していること、ネットティング効果等を勘案したことによるものです。デリバティブ取引等には長期決済期間取引を含みます。  
 ・ レボ形式の取引による差異は、主に、担保提供資産に係るエクスポージャーを加算したこと、担保・ネットティング効果等を勘案したことによるものです。  
 ・ その他の差異は、主に、繰延税金資産と繰延税金負債の相殺処理、規制上認められるヘッジ効果の勘案、及びその他規制上保守的な調整によるものです。

(単位：百万円)

項番		2022年度					
		合計	イ	ロ	ハ	ニ	ホ
			対応する項目				
			信用リスク(ハ欄及びニ欄に該当する額を除く。)	カウンターパーティ信用リスク	証券化エクスポージャー(ホ欄に該当する額を除く。)	マーケット・リスク	
1	自己資本比率規制上の連結範囲に基づく資産の額	6,667,318	6,522,120	141,181	4,015	—	
2	自己資本比率規制上の連結範囲に基づく負債の額	7,748	—	7,748	—	—	
3	自己資本比率規制上の連結範囲に基づく資産及び負債の純額	6,659,569	6,522,120	133,433	4,015	—	
4	オフ・バランスシートの額	328,324	328,324	—	—	—	
5	引当て及び償却を勘案することによる差異	3,820	3,820	—	—	—	
6	デリバティブ取引等による差異	△68,230	—	△68,230	—	—	
7	レボ形式の取引による差異	55,774	—	55,774	—	—	
8	その他の差異	14,580	14,580	—	—	—	
9	自己資本比率規制上のエクスポージャーの額	6,993,840	6,868,846	120,977	4,015	—	

注) 1. 複数のリスク・カテゴリーで資本賦課の対象となるエクスポージャーが存在するため、イ欄は口欄からホ欄までの合計と一致しない場合があります。  
 2. 自己資本比率規制上のエクスポージャーの額と連結貸借対照表計上額との差異及びその要因に関する説明は以下の通りです。  
 ・ オフ・バランスシートの額は、主に、コミットメントラインの未引出額に係るエクスポージャーを加算したこと、支払承諾見返に自己資本比率規制上のオフ・バランス項目に適用される掛目を乗じたことによる差異です。  
 ・ 引当て及び償却を勘案することによる差異は、主に、内部格付手法対象の資産につき、貸倒引当金・部分直接償却等を調整したことによるものです。  
 ・ デリバティブ取引等による差異は、主に、規制上のエクスポージャーに将来の時価変動を反映していること、ネットティング効果等を勘案したことによるものです。デリバティブ取引等には長期決済期間取引を含みます。  
 ・ レボ形式の取引による差異は、主に、担保提供資産に係るエクスポージャーを加算したこと、担保・ネットティング効果等を勘案したことによるものです。  
 ・ その他の差異は、主に、繰延税金資産と繰延税金負債の相殺処理、規制上認められるヘッジ効果の勘案、及びその他規制上保守的な調整によるものです。

## ■信用リスク

### (1) 信用リスクに関する定量的開示事項

カウンターパーティ信用リスク、証券化エクスポージャー、信用リスク・アセットのみなし計算が適用されるエクスポージャーを除いています。

#### (A) CR1：資産の信用の質

(単位：百万円)

項番	2021年度				
	イ	ロ	ハ	ニ	
	帳簿価額の デフォルトした エクスポージャー	の総額 非デフォルト エクスポージャー	引当金	ネット金額 (イ+ロ-ハ)	
<b>オン・バランスシートの資産</b>					
1	貸出金	14,334	3,165,585	2,811	3,177,108
2	有価証券(うち負債性のもの)	—	118,347	—	118,347
3	その他オン・バランスシートの資産(うち負債性のもの)	1,972	2,114,102	11	2,116,063
4	<b>オン・バランスシートの資産の合計(1+2+3)</b>	<b>16,307</b>	<b>5,398,034</b>	<b>2,822</b>	<b>5,411,519</b>
<b>オフ・バランスシートの資産</b>					
5	支払承諾等	—	14,109	15	14,094
6	コミットメント等	351	406,591	—	406,942
7	<b>オフ・バランスシートの資産の合計(5+6)</b>	<b>351</b>	<b>420,701</b>	<b>15</b>	<b>421,037</b>
8	<b>合計(4+7)</b>	<b>16,658</b>	<b>5,818,735</b>	<b>2,837</b>	<b>5,832,556</b>

注) 1. その他オン・バランスシートの資産(うち負債性のもの)には預け金、コールローン、買入手形、買入金銭債権、金銭の信託、外国為替等が含まれます。  
2. デフォルトしたエクスポージャーには貸出条件緩和債権、3ヵ月以上延滞債権、破綻先債権等が含まれます。  
3. 引当金は貸倒引当金の金額です。

(単位：百万円)

項番	2022年度				
	イ	ロ	ハ	ニ	
	帳簿価額の デフォルトした エクスポージャー	の総額 非デフォルト エクスポージャー	引当金	ネット金額 (イ+ロ-ハ)	
<b>オン・バランスシートの資産</b>					
1	貸出金	21,010	3,032,255	3,502	3,049,763
2	有価証券(うち負債性のもの)	—	100,451	—	100,451
3	その他オン・バランスシートの資産(うち負債性のもの)	—	2,874,970	9	2,874,961
4	<b>オン・バランスシートの資産の合計(1+2+3)</b>	<b>21,010</b>	<b>6,007,678</b>	<b>3,512</b>	<b>6,025,176</b>
<b>オフ・バランスシートの資産</b>					
5	支払承諾等	—	13,655	9	13,646
6	コミットメント等	85	391,633	—	391,718
7	<b>オフ・バランスシートの資産の合計(5+6)</b>	<b>85</b>	<b>405,288</b>	<b>9</b>	<b>405,364</b>
8	<b>合計(4+7)</b>	<b>21,095</b>	<b>6,412,966</b>	<b>3,521</b>	<b>6,430,540</b>

注) 1. その他オン・バランスシートの資産(うち負債性のもの)には預け金、コールローン、買入手形、買入金銭債権、金銭の信託、外国為替等が含まれます。  
2. デフォルトしたエクスポージャーには貸出条件緩和債権、3ヵ月以上延滞債権、破綻先債権等が含まれます。  
3. 引当金は貸倒引当金の金額です。

## みずほ信託銀行連結の自己資本の充実の状況

## (B) 信用リスクに関するエクスポージャーの区分ごとの期末残高と主な種類別内訳

## (a) 地域別内訳

(単位：億円)

	2021年度				2022年度			
	貸出金・コミットメント・デリバティブ以外のオフ・バランス	有価証券	その他	合計	貸出金・コミットメント・デリバティブ以外のオフ・バランス	有価証券	その他	合計
国内	36,179	2,900	22,702	61,781	34,963	2,648	30,220	67,832
海外	275	1	4	281	65	2	5	72
アジア	75	1	0	77	57	2	0	59
中南米	—	—	—	—	—	—	—	—
北米	—	—	0	0	—	—	0	0
東欧	—	—	—	—	—	—	—	—
西欧	0	0	3	3	—	0	4	5
その他の地域	199	—	0	199	7	—	0	7
合計	36,454	2,902	22,706	62,063	35,028	2,650	30,225	67,905
標準的手法適用分	/	/	/	2,115	/	/	/	2,278

注) 1. 標準的手法適用分は、信用リスク・アセットの額を算出するにあたって重要でない事業単位または資産区分に対して適用した標準的手法による金額です。  
 2. 非居住者分は海外に含みます。  
 3. その他には現金、預け金、コールローン、買入金銭債権、金銭の信託、外国為替、その他資産等が含まれます。

## (b) 業種別内訳

(単位：億円)

	2021年度				2022年度			
	貸出金・コミットメント・デリバティブ以外のオフ・バランス	有価証券	その他	合計	貸出金・コミットメント・デリバティブ以外のオフ・バランス	有価証券	その他	合計
製造業	5,909	900	27	6,837	5,809	828	39	6,676
建設業	497	86	—	583	518	77	—	596
不動産業	14,767	1,193	1	15,962	14,870	1,074	0	15,946
各種サービス業	899	34	0	934	785	35	0	821
卸売・小売業	1,729	184	114	2,028	1,597	196	111	1,905
金融・保険業	3,472	72	2,118	5,663	3,332	74	1,979	5,386
個人	611	—	0	611	516	—	—	516
その他の業種	8,567	430	1,360	10,358	7,597	363	1,203	9,164
日本国・日本銀行	0	—	19,084	19,084	0	—	26,890	26,891
合計	36,454	2,902	22,706	62,063	35,028	2,650	30,225	67,905
標準的手法適用分	/	/	/	2,115	/	/	/	2,278

注) 1. 標準的手法適用分は、信用リスク・アセットの額を算出するにあたって重要でない事業単位または資産区分に対して適用した標準的手法による金額です。  
 2. その他には現金、預け金、コールローン、買入金銭債権、金銭の信託、外国為替、その他資産等が含まれます。

## (c) 残存期間別内訳

(単位：億円)

	2021年度				2022年度			
	貸出金・コミットメント・デリバティブ以外のオフ・バランス	有価証券	その他	合計	貸出金・コミットメント・デリバティブ以外のオフ・バランス	有価証券	その他	合計
1年未満	7,565	—	20,527	28,092	6,342	1	28,448	34,792
1年以上3年未満	7,850	37	0	7,889	8,223	203	—	8,427
3年以上5年未満	8,029	354	0	8,384	8,902	191	0	9,094
5年以上	12,912	501	180	13,594	11,461	290	146	11,898
期間の定めのないもの等	96	2,007	1,997	4,102	98	1,963	1,630	3,692
合計	36,454	2,902	22,706	62,063	35,028	2,650	30,225	67,905
標準的手法適用分	/	/	/	2,115	/	/	/	2,278

注) 1. 標準的手法適用分は、信用リスク・アセットの額を算出するにあたって重要でない事業単位または資産区分に対して適用した標準的手法による金額です。  
 2. その他には現金、預け金、コールローン、買入金銭債権、金銭の信託、外国為替、その他資産等が含まれます。

(C) 金融機能の再生のための緊急措置に関する法律施行規則第4条第2項、第3項又は第4項に規定する債権に係る債務者のエクスポージャー

(a) 地域別内訳

(単位：億円)

	2021年度			2022年度		
	期末残高	引当金の額	償却額	期末残高	引当金の額	償却額
国内	80	6	0	153	20	0
海外	67	1	—	57	1	—
アジア	67	1	—	57	1	—
中南米	—	—	—	—	—	—
北米	—	—	—	—	—	—
東欧	—	—	—	—	—	—
西欧	—	—	—	—	—	—
その他の地域	—	—	—	—	—	—
合計	147	8	0	211	22	0
標準的手法適用分	—	—	—	—	—	—

注) 標準的手法適用分は、信用リスク・アセットの額を算出するにあたって重要でない事業単位または資産区分に対して適用した標準的手法による金額です。

(b) 業種別内訳

(単位：億円)

	2021年度			2022年度		
	期末残高	引当金の額	償却額	期末残高	引当金の額	償却額
製造業	2	0	0	116	15	—
建設業	—	—	—	—	—	—
不動産業	30	0	—	1	—	—
各種サービス業	10	2	—	7	2	—
卸売・小売業	15	2	—	10	2	—
金融・保険業	—	—	—	—	—	—
個人	21	0	0	15	0	0
その他の業種	67	1	—	59	1	—
合計	147	8	0	211	22	0
標準的手法適用分	—	—	—	—	—	—

注) 標準的手法適用分は、信用リスク・アセットの額を算出するにあたって重要でない事業単位または資産区分に対して適用した標準的手法による金額です。

(D) 延滞期間別のエクスポージャー

(単位：億円)

2021年度				
1ヵ月未満	1ヵ月以上2ヵ月未満	2ヵ月以上3ヵ月未満	3ヵ月以上	合計
8	2	3	0	14

注) 金融機能の再生のための緊急措置に関する法律施行規則第4条第2項に規定する破産更生債権及びこれらに準ずる債権、同条第3項に規定する危険債権に該当するものを除きます。

(単位：億円)

2022年度				
1ヵ月未満	1ヵ月以上2ヵ月未満	2ヵ月以上3ヵ月未満	3ヵ月以上	合計
11	3	2	—	16

注) 金融機能の再生のための緊急措置に関する法律施行規則第4条第2項に規定する破産更生債権及びこれらに準ずる債権、同条第3項に規定する危険債権に該当するものを除きます。

みずほ信託銀行連結の自己資本の充実の状況

(E) 経営再建又は支援を図ることを目的として貸出条件の緩和を実施した債権に係る債務者のエクスポージャー (単位：億円)

2021年度		
期末残高	うち、貸出条件の緩和を実施したことに伴い、当該エクスポージャーに係る引当金の額を増加させたものの額	うち、それ以外のものの額
30	15	15

注) 金融機能の再生のための緊急措置に関する法律施行規則第4条第2項に規定する破産更生債権及びこれらに準ずる債権、同条第3項に規定する危険債権または同条第4項に規定する3ヵ月以上延滞債権に該当するものを除きます。

(単位：億円)

2022年度		
期末残高	うち、貸出条件の緩和を実施したことに伴い、当該エクスポージャーに係る引当金の額を増加させたものの額	うち、それ以外のものの額
136	82	54

注) 金融機能の再生のための緊急措置に関する法律施行規則第4条第2項に規定する破産更生債権及びこれらに準ずる債権、同条第3項に規定する危険債権または同条第4項に規定する3ヵ月以上延滞債権に該当するものを除きます。

(F) CR2：デフォルトした貸出金・有価証券等(うち負債性のもの)の残高の変動 (単位：百万円)

2021年度		
項番		額
1	2020年度末時点においてデフォルト状態にある貸出金・有価証券等(うち負債性のもの)の残高	8,097
2		デフォルトした額
3	貸出金・有価証券等(うち負債性のもの)の期中の要因別の	414
4	変動額	償却された額
5		その他の変動額
6	2021年度末時点においてデフォルト状態にある貸出金・有価証券等(うち負債性のもの)の残高(1+2-3-4+5)	16,307

注) その他の変動額はデフォルト状態にあるエクスポージャーの回収による残高減少、デフォルト期間中の追加与信等によるものです。

(単位：百万円)

2022年度		
項番		額
1	2021年度末時点においてデフォルト状態にある貸出金・有価証券等(うち負債性のもの)の残高	16,307
2		デフォルトした額
3	貸出金・有価証券等(うち負債性のもの)の期中の要因別の	1,540
4	変動額	償却された額
5		その他の変動額
6	2022年度末時点においてデフォルト状態にある貸出金・有価証券等(うち負債性のもの)の残高(1+2-3-4+5)	21,010

注) その他の変動額はデフォルト状態にあるエクスポージャーの回収による残高減少、デフォルト期間中の追加与信等によるものです。

(2) 内部格付手法における信用リスク

(i) 信用リスク・アセットの額を算出する手法の種類ごとの資産区分別のEADがEADの総額に占める割合

	2021年度	2022年度
内部格付手法	96.58%	96.66%
事業法人等向け	88.61%	89.90%
リテール向け	2.56%	2.08%
株式等	3.27%	2.90%
購入債権	0.22%	0.21%
その他	1.90%	1.54%
標準的手法	3.41%	3.33%
合計	100.00%	100.00%

注) 1.カウンターパーティ信用リスク、証券化エクスポージャー、信用リスク・アセットのみなし計算が適用されるエクスポージャーを除いています。  
2.EADは、標準的手法が適用されるポートフォリオにあっては、エクスポージャーの額です。

## (ii) 内部格付手法に関する定量的開示事項

## (A) CR6：内部格付手法-ポートフォリオ及びデフォルト率(PD)区分別の信用リスク・エクスポージャー

(単位：百万円、%、千件、年)

項番	PD 区分	2021年度											
		イ オン・バランス シート・グロス エクスポー ジャーの額	ロ CCF・信用リスク 削減手法適用前 のオフ・バ ランス シート・エ クスポー ジャーの額	ハ 平均CCF	ニ CCF・信用 リスク削減 手法適用後 EAD	ホ 平均PD	ヘ 債務者の数	ト 平均LGD	チ 平均残存期間	リ 信用リス ク・アセ ットの額	ヌ リスク・ウ ェイト の加重平均 値 (RWA density)	ル EL	ヲ 適格引当金
ソブリン向けエクスポージャー													
1	0.00 以上0.15 未満	1,918,930	7	—	1,925,298	0.00	0.0	37.60	0.0	1,940	0.10	1	/
2	0.15 以上0.25 未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	/
3	0.25 以上0.50 未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	/
4	0.50 以上0.75 未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	/
5	0.75 以上2.50 未満	9	—	—	0	1.24	0.0	37.61	1.7	0	75.20	0	/
6	2.50 以上10.00 未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	/
7	10.00 以上100.00 未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	/
8	100.00(デフォルト)	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	/
9	小計	1,918,940	7	—	1,925,299	0.00	0.0	37.60	0.0	1,940	0.10	1	1
金融機関等向けエクスポージャー													
1	0.00 以上0.15 未満	160,163	71	100.00	160,234	0.03	0.0	37.61	1.5	19,143	11.94	19	/
2	0.15 以上0.25 未満	0	—	—	0	0.19	0.0	37.61	0.0	0	16.74	0	/
3	0.25 以上0.50 未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	/
4	0.50 以上0.75 未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	/
5	0.75 以上2.50 未満	3,000	—	—	3,000	1.24	0.0	37.61	0.0	1,694	56.48	14	/
6	2.50 以上10.00 未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	/
7	10.00 以上100.00 未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	/
8	100.00(デフォルト)	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	/
9	小計	163,163	71	100.00	163,234	0.05	0.0	37.61	1.4	20,837	12.76	33	20
事業法人向けエクスポージャー(中堅中小企業向けエクスポージャー及び特定貸付債権を除く。)													
1	0.00 以上0.15 未満	2,059,105	423,416	70.01	2,376,946	0.05	0.4	38.06	2.6	451,471	18.99	527	/
2	0.15 以上0.25 未満	45,381	10,114	11.56	46,670	0.19	0.0	33.80	2.5	16,041	34.37	30	/
3	0.25 以上0.50 未満	27,205	1,223	62.74	27,772	0.41	0.0	28.41	1.3	9,748	35.10	32	/
4	0.50 以上0.75 未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	/
5	0.75 以上2.50 未満	53,356	5,366	83.13	57,769	1.21	0.0	31.66	2.1	36,746	63.60	215	/
6	2.50 以上10.00 未満	28,177	321	51.66	22,083	3.45	0.0	22.24	3.4	15,543	70.38	188	/
7	10.00 以上100.00 未満	12,683	—	—	12,683	13.00	0.0	15.47	2.0	8,943	70.51	255	/
8	100.00(デフォルト)	2,402	351	74.99	2,665	100.00	0.0	21.65	1.4	669	25.11	523	/
9	小計	2,228,312	440,793	68.80	2,546,592	0.29	0.6	37.46	2.6	539,165	21.17	1,773	1,108
中堅中小企業向けエクスポージャー													
1	0.00 以上0.15 未満	13,882	1,000	—	13,882	0.10	0.0	36.69	3.0	3,882	27.96	5	/
2	0.15 以上0.25 未満	16,212	540	33.37	17,392	0.19	0.0	23.96	3.3	3,411	19.61	7	/
3	0.25 以上0.50 未満	27,941	1,466	90.84	28,274	0.41	0.1	8.31	4.8	3,717	13.14	9	/
4	0.50 以上0.75 未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	/
5	0.75 以上2.50 未満	108,886	5,116	98.71	113,937	1.13	0.5	7.93	4.9	19,283	16.92	100	/
6	2.50 以上10.00 未満	44,466	859	87.66	45,219	2.72	0.1	7.97	4.9	9,611	21.25	98	/
7	10.00 以上100.00 未満	2,486	—	—	2,486	13.00	0.0	7.73	4.7	783	31.52	25	/
8	100.00(デフォルト)	525	—	—	525	100.00	0.0	58.08	5.0	162	30.98	292	/
9	小計	214,400	8,983	81.45	221,717	1.59	0.9	11.16	4.6	40,852	18.42	538	336
特定貸付債権													
1	0.00 以上0.15 未満	621,561	18,095	75.00	619,894	0.06	0.1	29.80	4.2	131,060	21.14	119	/
2	0.15 以上0.25 未満	2,853	—	—	2,853	0.19	0.0	28.71	3.7	978	34.29	1	/
3	0.25 以上0.50 未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	/
4	0.50 以上0.75 未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	/
5	0.75 以上2.50 未満	4,000	—	—	4,000	2.15	0.0	28.71	5.0	3,800	95.02	24	/
6	2.50 以上10.00 未満	2,488	—	—	2,488	2.71	0.0	37.61	5.0	3,247	130.51	25	/
7	10.00 以上100.00 未満	2,716	—	—	2,716	13.00	0.0	31.30	1.1	3,705	136.40	110	/
8	100.00(デフォルト)	9,542	—	—	3,433	100.00	0.0	16.70	2.5	391	11.39	542	/
9	小計	643,161	18,095	75.00	635,385	0.68	0.1	29.76	4.2	143,183	22.53	824	515
株式等エクスポージャー(PD/LGD方式が適用されるエクスポージャー)													
1	0.00 以上0.15 未満	149,385	—	—	149,385	0.05	0.2	90.00	5.0	151,392	101.34	/	/
2	0.15 以上0.25 未満	3,847	—	—	3,847	0.19	0.0	90.00	5.0	5,208	135.37	/	/
3	0.25 以上0.50 未満	3,892	—	—	3,892	0.41	0.0	90.00	5.0	7,601	195.27	/	/
4	0.50 以上0.75 未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	/	/
5	0.75 以上2.50 未満	4,868	—	—	4,868	1.02	0.0	90.00	5.0	12,439	255.50	/	/
6	2.50 以上10.00 未満	1,784	—	—	1,784	4.10	0.0	90.00	5.0	6,902	386.89	/	/
7	10.00 以上100.00 未満	387	—	—	387	13.00	0.0	90.00	5.0	2,425	626.18	/	/
8	100.00(デフォルト)	50	—	—	50	100.00	0.0	90.00	5.0	568	1,125.00	/	/
9	小計	164,215	—	—	164,215	0.20	0.4	90.00	5.0	186,538	113.59	/	/

(次ページへ続く)

みずほ信託銀行連結の自己資本の充実の状況

(続き)

(単位：百万円、%、千件、年)

		2021年度											
項番	PD 区分	イ オン・バランス シート・クロス エクスポー ジャーの額	ロ CCF・信用リスク 削減手法適用前 のオフ・バランス シート・エク スポージャーの額	ハ 平均CCF	ニ CCF・信用 リスク削減 手法適用後 EAD	ホ 平均PD	ヘ 債務者の数	ト 平均LGD	チ 平均残存期間	リ 信用リス ク・アセッ トの額	ヌ リスク・ウェイト の加重平均値 (RWA density)	ル EL	ヲ 適格引当金
<b>購入債権(事業法人等向け) - デフォルト・リスク相当分</b>													
1	0.00 以上0.15 未満	14,149	—	—	13,950	0.03	0.0	37.61	0.0	534	3.83	2	／
2	0.15 以上0.25 未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	／
3	0.25 以上0.50 未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	／
4	0.50 以上0.75 未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	／
5	0.75 以上2.50 未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	／
6	2.50 以上10.00 未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	／
7	10.00 以上100.00 未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	／
8	100.00(デフォルト)	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	／
9	小計	14,149	—	—	13,950	0.03	0.0	37.61	0.0	534	3.83	2	1
<b>購入債権(リテール向け) - デフォルト・リスク相当分</b>													
1	0.00 以上0.15 未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	／
2	0.15 以上0.25 未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	／
3	0.25 以上0.50 未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	／
4	0.50 以上0.75 未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	／
5	0.75 以上2.50 未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	／
6	2.50 以上10.00 未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	／
7	10.00 以上100.00 未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	／
8	100.00(デフォルト)	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	／
9	小計	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
<b>購入債権(希薄化リスク相当分)</b>													
1	0.00 以上0.15 未満	11,426	—	—	11,426	0.03	0.0	32.32	—	876	7.66	1	／
2	0.15 以上0.25 未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	／
3	0.25 以上0.50 未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	／
4	0.50 以上0.75 未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	／
5	0.75 以上2.50 未満	2,723	—	—	2,723	0.78	0.0	32.32	—	1,489	54.70	7	／
6	2.50 以上10.00 未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	／
7	10.00 以上100.00 未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	／
8	100.00(デフォルト)	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	／
9	小計	14,149	—	—	14,149	0.18	0.0	32.32	—	2,365	16.72	9	／
<b>適格リボルビング型リテール向けエクスポージャー</b>													
1	0.00 以上0.15 未満	—	—	—	—	—	—	—	／	—	—	—	／
2	0.15 以上0.25 未満	—	—	—	—	—	—	—	／	—	—	—	／
3	0.25 以上0.50 未満	—	—	—	—	—	—	—	／	—	—	—	／
4	0.50 以上0.75 未満	—	—	—	—	—	—	—	／	—	—	—	／
5	0.75 以上2.50 未満	—	—	—	—	—	—	—	／	—	—	—	／
6	2.50 以上10.00 未満	—	—	—	—	—	—	—	／	—	—	—	／
7	10.00 以上100.00 未満	—	—	—	—	—	—	—	／	—	—	—	／
8	100.00(デフォルト)	4	—	—	4	100.00	0.0	100.00	／	—	—	4	／
9	小計	4	—	—	4	100.00	0.0	100.00	／	—	—	4	2
<b>居住用不動産向けエクスポージャー</b>													
1	0.00 以上0.15 未満	267	—	—	267	0.10	0.2	43.43	／	28	10.59	0	／
2	0.15 以上0.25 未満	2,492	—	—	2,492	0.24	0.3	43.43	／	499	20.06	2	／
3	0.25 以上0.50 未満	14,363	—	—	14,363	0.34	1.7	43.43	／	3,697	25.74	21	／
4	0.50 以上0.75 未満	25,546	9	100.00	25,555	0.67	1.8	43.43	／	10,625	41.57	74	／
5	0.75 以上2.50 未満	5,153	—	—	5,153	1.02	0.4	43.43	／	2,847	55.26	22	／
6	2.50 以上10.00 未満	519	—	—	519	8.97	0.0	43.43	／	979	188.57	20	／
7	10.00 以上100.00 未満	435	—	—	435	55.83	0.0	43.43	／	801	184.15	105	／
8	100.00(デフォルト)	844	—	—	844	100.00	0.0	47.67	／	558	66.20	357	／
9	小計	49,622	9	100.00	49,631	2.84	4.8	43.50	／	20,040	40.37	605	378
<b>その他リテール向けエクスポージャー</b>													
1	0.00 以上0.15 未満	22	—	—	22	0.09	0.0	58.34	／	2	12.80	0	／
2	0.15 以上0.25 未満	27	—	—	27	0.19	0.0	43.43	／	4	17.24	0	／
3	0.25 以上0.50 未満	104,442	59	100.00	104,501	0.31	2.8	49.44	／	28,263	27.04	163	／
4	0.50 以上0.75 未満	931	—	—	931	0.70	0.8	79.61	／	640	68.80	5	／
5	0.75 以上2.50 未満	1,673	—	—	1,673	1.68	0.4	43.43	／	892	53.31	12	／
6	2.50 以上10.00 未満	334	—	—	334	3.04	0.4	—	／	—	—	—	／
7	10.00 以上100.00 未満	476	—	—	476	23.68	0.1	58.75	／	619	129.88	64	／
8	100.00(デフォルト)	1,265	—	—	1,265	100.00	0.1	56.45	／	1,036	81.93	631	／
9	小計	109,174	59	100.00	109,233	1.60	4.8	49.57	／	31,460	28.80	877	548
<b>合計(全てのポートフォリオ)</b>		<b>5,519,294</b>	<b>468,018</b>	<b>69.29</b>	<b>5,843,415</b>	<b>0.32</b>	<b>11.7</b>	<b>37.42</b>	<b>2.0</b>	<b>986,920</b>	<b>16.88</b>	<b>4,668</b>	<b>2,912</b>

注) 1. カウンターパーティ信用リスク、証券化エクスポージャー、信用リスク・アセットのみならず計算が適用されるエクスポージャーを除いています。  
 2. オン・バランスシート・グロスエクスポージャーの額、CCF・信用リスク削減手法適用前のオフ・バランスシート・エクスポージャーの額、平均CCFは信用リスク削減手法適用前のPD推計値に基づき、PD区分に割り当てています。  
 3. 債務者の数は、適格リボルビング型リテール向けエクスポージャー、居住用不動産向けエクスポージャー、その他リテール向けエクスポージャー(事業性と信を除く)においては、債権の数を開示しています。

(単位：百万円、%、千件、年)

		2022年度											
		イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ	ト	チ	リ	ヌ	ル	ヲ
項番	PD 区分	オン・バランスシート・エクスポージャーの額	CCF・信用リスク削減手法適用前のオフ・バランスシート・エクスポージャーの額	平均CCF	CCF・信用リスク削減手法適用後のEAD	平均PD	債務者の数	平均LGD	平均残存期間	信用リスク・アセットの額	リスク・ウェイトの加重平均値(RWA density)	EL	適格引当金
<b>ソブリン向けエクスポージャー</b>													
1	0.00 以上0.15 未満	2,696,007	7	—	2,701,421	0.00	0.0	37.03	0.0	1,257	0.04	1	/
2	0.15 以上0.25 未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	/
3	0.25 以上0.50 未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	/
4	0.50 以上0.75 未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	/
5	0.75 以上2.50 未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	/
6	2.50 以上10.00 未満	5	4	75.00	3	2.99	0.0	37.03	4.5	4	126.77	0	/
7	10.00 以上100.00 未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	/
8	100.00(デフォルト)	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	/
9	小計	2,696,013	11	28.53	2,701,425	0.00	0.0	37.03	0.0	1,261	0.04	1	0
<b>金融機関等向けエクスポージャー</b>													
1	0.00 以上0.15 未満	172,157	44	100.00	172,202	0.03	0.0	37.03	1.3	18,077	10.49	19	/
2	0.15 以上0.25 未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	/
3	0.25 以上0.50 未満	0	—	—	0	0.41	0.0	37.03	0.0	0	29.48	0	/
4	0.50 以上0.75 未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	/
5	0.75 以上2.50 未満	3,000	—	—	3,000	1.24	0.0	37.03	0.0	1,666	55.55	13	/
6	2.50 以上10.00 未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	/
7	10.00 以上100.00 未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	/
8	100.00(デフォルト)	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	/
9	小計	175,157	44	100.00	175,202	0.05	0.0	37.03	1.2	19,744	11.26	33	25
<b>事業法人向けエクスポージャー(中堅中小企業向けエクスポージャー及び特定貸付債権を除く。)</b>													
1	0.00 以上0.15 未満	1,896,246	404,659	69.89	2,189,862	0.05	0.4	37.36	2.8	392,040	17.90	406	/
2	0.15 以上0.25 未満	110,088	15,956	33.37	110,804	0.18	0.0	35.89	2.2	35,374	31.92	75	/
3	0.25 以上0.50 未満	44,324	6,655	72.74	48,996	0.41	0.0	34.99	1.4	23,771	48.51	70	/
4	0.50 以上0.75 未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	/
5	0.75 以上2.50 未満	27,854	4,038	96.09	31,605	1.06	0.0	33.01	1.6	19,184	60.69	108	/
6	2.50 以上10.00 未満	19,598	700	21.42	13,918	4.09	0.0	18.20	2.7	7,914	56.86	119	/
7	10.00 以上100.00 未満	6,009	—	—	5,921	12.97	0.0	32.31	1.9	8,745	147.69	248	/
8	100.00(デフォルト)	13,501	85	75.00	13,565	100.00	0.0	15.27	2.8	2,165	15.96	1,898	/
9	小計	2,117,623	432,093	68.75	2,414,674	0.69	0.5	36.94	2.7	489,195	20.25	2,927	2,176
<b>中堅中小企業向けエクスポージャー</b>													
1	0.00 以上0.15 未満	11,020	1,000	—	11,020	0.12	0.0	36.12	2.7	2,840	25.77	4	/
2	0.15 以上0.25 未満	12,438	253	—	12,438	0.18	0.0	7.94	4.5	930	7.47	1	/
3	0.25 以上0.50 未満	24,814	3,228	84.52	27,543	0.41	0.1	9.57	4.7	3,884	14.10	10	/
4	0.50 以上0.75 未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	/
5	0.75 以上2.50 未満	107,911	4,802	94.03	112,427	1.12	0.5	7.82	4.9	18,704	16.63	100	/
6	2.50 以上10.00 未満	49,149	620	83.30	49,502	2.71	0.1	7.26	4.9	9,520	19.23	97	/
7	10.00 以上100.00 未満	2,863	—	—	2,863	12.97	0.0	6.24	4.7	726	25.37	23	/
8	100.00(デフォルト)	514	—	—	514	100.00	0.0	45.86	4.7	78	15.28	229	/
9	小計	208,712	9,906	78.36	216,311	1.68	0.8	9.43	4.7	36,686	16.95	468	348
<b>特定貸付債権</b>													
1	0.00 以上0.15 未満	616,442	10,509	75.00	624,324	0.05	0.1	29.43	3.9	118,656	19.00	106	/
2	0.15 以上0.25 未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	/
3	0.25 以上0.50 未満	4,000	—	—	4,000	0.41	0.0	28.47	5.0	2,321	58.03	4	/
4	0.50 以上0.75 未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	/
5	0.75 以上2.50 未満	120	—	—	120	0.77	0.0	28.47	1.8	58	48.35	0	/
6	2.50 以上10.00 未満	2,137	—	—	2,137	2.70	0.0	37.03	5.0	2,744	128.42	21	/
7	10.00 以上100.00 未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	/
8	100.00(デフォルト)	5,790	—	—	5,790	100.00	0.0	52.26	3.1	316	54.62	277	/
9	小計	628,490	10,509	75.00	631,161	0.16	0.1	29.47	3.9	124,097	19.66	409	304
<b>株式等エクスポージャー(PD/LGD方式が適用されるエクスポージャー)</b>													
1	0.00 以上0.15 未満	139,692	—	—	139,692	0.05	0.2	90.00	5.0	140,758	100.76	/	/
2	0.15 以上0.25 未満	6,525	—	—	6,525	0.18	0.0	90.00	5.0	8,750	134.09	/	/
3	0.25 以上0.50 未満	1,980	—	—	1,980	0.41	0.0	90.00	5.0	3,744	188.99	/	/
4	0.50 以上0.75 未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	/	/
5	0.75 以上2.50 未満	4,096	—	—	4,096	1.16	0.0	90.00	5.0	11,026	269.14	/	/
6	2.50 以上10.00 未満	1,341	—	—	1,341	4.31	0.0	90.00	5.0	5,277	393.49	/	/
7	10.00 以上100.00 未満	455	—	—	455	12.97	0.0	90.00	5.0	2,851	625.51	/	/
8	100.00(デフォルト)	50	—	—	50	100.00	0.0	90.00	5.0	564	1,125.00	/	/
9	小計	154,143	—	—	154,143	0.19	0.4	90.00	5.0	172,973	112.21	/	/

(次ページへ続く)

みずほ信託銀行連結の自己資本の充実の状況

(続き)

(単位：百万円、%、千件、年)

項番	PD 区分	2022年度											
		イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ	ト	チ	リ	ヌ	ル	ヲ
		オン・バランスシート・クロスエクスポージャーの額	CCF・信用リスク削減手法適用前のオフ・バランスシート・エクスポージャーの額	平均CCF	CCF・信用リスク削減手法適用後のEAD	平均PD	債務者の数	平均LGD	平均残存期間	信用リスク・アセットの額	リスク・ウェイトの加重平均値(RWA density)	EL	適格引当金
購入債権(事業法人等向け) - デフォルト・リスク相当分													
1	0.00 以上0.15 未満	15,024	—	—	14,850	0.03	0.0	37.03	0.0	568	3.82	2	/
2	0.15 以上0.25 未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	/
3	0.25 以上0.50 未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	/
4	0.50 以上0.75 未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	/
5	0.75 以上2.50 未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	/
6	2.50 以上10.00 未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	/
7	10.00 以上100.00 未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	/
8	100.00(デフォルト)	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	/
9	小計	15,024	—	—	14,850	0.03	0.0	37.03	0.0	568	3.82	2	1
購入債権(リテール向け) - デフォルト・リスク相当分													
1	0.00 以上0.15 未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	/
2	0.15 以上0.25 未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	/
3	0.25 以上0.50 未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	/
4	0.50 以上0.75 未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	/
5	0.75 以上2.50 未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	/
6	2.50 以上10.00 未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	/
7	10.00 以上100.00 未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	/
8	100.00(デフォルト)	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	/
9	小計	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
購入債権(希薄化リスク相当分)													
1	0.00 以上0.15 未満	11,112	—	—	11,112	0.03	0.0	32.32	—	852	7.66	1	/
2	0.15 以上0.25 未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	/
3	0.25 以上0.50 未満	3,157	—	—	3,157	0.41	0.0	32.32	—	1,242	39.36	4	/
4	0.50 以上0.75 未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	/
5	0.75 以上2.50 未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	/
6	2.50 以上10.00 未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	/
7	10.00 以上100.00 未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	/
8	100.00(デフォルト)	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	/
9	小計	14,270	—	—	14,270	0.12	0.0	32.32	—	2,094	14.68	6	/
適格リボルビング型リテール向けエクスポージャー													
1	0.00 以上0.15 未満	—	—	—	—	—	—	—	/	—	—	—	/
2	0.15 以上0.25 未満	—	—	—	—	—	—	—	/	—	—	—	/
3	0.25 以上0.50 未満	—	—	—	—	—	—	—	/	—	—	—	/
4	0.50 以上0.75 未満	—	—	—	—	—	—	—	/	—	—	—	/
5	0.75 以上2.50 未満	—	—	—	—	—	—	—	/	—	—	—	/
6	2.50 以上10.00 未満	—	—	—	—	—	—	—	/	—	—	—	/
7	10.00 以上100.00 未満	—	—	—	—	—	—	—	/	—	—	—	/
8	100.00(デフォルト)	—	—	—	—	—	—	—	/	—	—	—	/
9	小計	—	—	—	—	—	—	—	/	—	—	—	—
居住用不動産向けエクスポージャー													
1	0.00 以上0.15 未満	164	—	—	164	0.09	0.1	43.28	/	16	9.76	0	/
2	0.15 以上0.25 未満	562	—	—	562	0.21	0.2	43.28	/	101	17.98	0	/
3	0.25 以上0.50 未満	15,695	—	—	15,695	0.35	2.0	43.28	/	4,102	26.13	23	/
4	0.50 以上0.75 未満	8,176	—	—	8,176	0.64	0.9	43.27	/	3,304	40.42	22	/
5	0.75 以上2.50 未満	16,296	—	—	16,296	0.95	0.5	43.28	/	8,496	52.13	67	/
6	2.50 以上10.00 未満	538	—	—	538	8.82	0.0	43.28	/	1,005	186.73	20	/
7	10.00 以上100.00 未満	394	—	—	394	49.97	0.0	43.28	/	793	201.17	85	/
8	100.00(デフォルト)	567	—	—	567	100.00	0.0	45.88	/	392	69.12	229	/
9	小計	42,395	—	—	42,395	2.54	4.1	43.31	/	18,212	42.95	449	334
その他リテール向けエクスポージャー													
1	0.00 以上0.15 未満	19	—	—	19	0.09	0.0	52.48	/	2	11.68	0	/
2	0.15 以上0.25 未満	36	—	—	36	0.21	0.0	43.28	/	6	18.22	0	/
3	0.25 以上0.50 未満	96,258	8	100.00	96,266	0.30	2.5	49.78	/	25,833	26.83	148	/
4	0.50 以上0.75 未満	694	—	—	694	0.71	0.6	80.23	/	484	69.84	3	/
5	0.75 以上2.50 未満	1,205	—	—	1,205	1.67	0.3	43.28	/	640	53.16	8	/
6	2.50 以上10.00 未満	301	—	—	301	3.04	0.4	0.15	/	0	0.23	0	/
7	10.00 以上100.00 未満	352	—	—	352	23.64	0.0	62.90	/	496	140.87	53	/
8	100.00(デフォルト)	831	—	—	831	100.00	0.0	57.66	/	742	89.28	420	/
9	小計	99,698	8	100.00	99,706	1.25	4.2	49.88	/	28,208	28.29	634	471
合計(全てのポートフォリオ)		6,151,529	452,573	69.11	6,464,141	0.37	10.3	36.82	1.7	893,043	13.81	4,932	3,662

注) 1. カウンターパーティ信用リスク、証券化エクスポージャー、信用リスク・アセットのみならず計算が適用されるエクスポージャーを除いています。  
 2. オン・バランスシート・グロスエクスポージャーの額、CCF・信用リスク削減手法適用前のオフ・バランスシート・エクスポージャーの額、平均CCFは信用リスク削減手法適用前のPD推計値に基づき、PD区分に割り当てています。  
 3. 債務者の数は、適格リボルビング型リテール向けエクスポージャー、居住用不動産向けエクスポージャー、その他リテール向けエクスポージャー(事業性と信を除く)においては、債権の数を開示しています。

## (B) 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

(単位：億円)

項番			2021年度
			信用リスク・アセットの額
1	2020年度末時点における信用リスク・アセットの額		12,954
2	期中の要因別の変動額	資産の規模	△726
3		ポートフォリオの質	347
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	3
8		その他	2
9		2021年度末時点における信用リスク・アセットの額	

- 注) 1. カウンターパーティ信用リスク、証券化エクスポージャー、信用リスク・アセットのみなし計算が適用されるエクスポージャーを除いています。  
 2. 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。  
 3. 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。  
 4. 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より起因するリスク・アセットの変動額です。  
 5. 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。

(単位：億円)

項番			2022年度
			信用リスク・アセットの額
1	2021年度末時点における信用リスク・アセットの額		12,580
2	期中の要因別の変動額	資産の規模	△1,028
3		ポートフォリオの質	160
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	0
9		2022年度末時点における信用リスク・アセットの額	

- 注) 1. カウンターパーティ信用リスク、証券化エクスポージャー、信用リスク・アセットのみなし計算が適用されるエクスポージャーを除いています。  
 2. 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。  
 3. 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。  
 4. 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より起因するリスク・アセットの変動額です。  
 5. 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。

みずほ信託銀行連結の自己資本の充実の状況

(C) CR9：内部格付手法—ポートフォリオ別のデフォルト率(PD)のバック・テスト

(単位：%、件)

2021年度													
イ ポートフォリオ	ロ PD区分	ハ 相当する外部格付					ニ 加重平均PD (EAD加重)	ホ 相加平均PD	ヘ 債務者の数		ト 期中にデフォルトした 債務者の数	チ うち、期中に デフォルトした新たな 債務者の数	リ 過去の年平均 デフォルト率 (5年間)
		S&P	Moody's	Fitch	R&I	JCR			前期末	当期末			
		AAA~A-	Aaa~A3	AAA~A-	AAA~A-	AAA~A-							
事業法人等向け	0.00以上 0.10未満	AAA~A-	Aaa~A3	AAA~A-	AAA~A-	AAA~A-	0.04	0.05	551	551	—	—	—
	0.10以上 0.20未満	BBB+~ BBB-	Baa1~ Baa3	BBB+~ BBB-	BBB+~ BBB-	BBB+~ BBB-	0.13	0.13	138	120	—	—	—
	0.20以上 1.00未満	BB+~BB-	Ba1~Ba3	BB+~BB-	BB+~BB-	BB+~BB-	0.47	0.54	640	597	2	—	0.21
	1.00以上 5.00未満	B+~B-	B1~B3	B+~B-	B+~B-	B+~B-	1.96	1.97	542	574	1	—	0.21
	5.00以上 100.00未満	CCC+~ CCC-	Caa1~ Caa3	CCC+~ CCC-	CCC+~ CCC-	CCC~C	10.95	11.32	49	50	1	—	3.10
適格リボルビング型 リテール向け	0.00以上 0.10未満	/	/	/	/	/	—	—	—	—	—	—	—
	0.10以上 0.20未満	/	/	/	/	/	—	—	—	—	—	—	—
	0.20以上 1.00未満	/	/	/	/	/	—	—	—	—	—	—	—
	1.00以上 5.00未満	/	/	/	/	/	—	—	—	—	—	—	—
	5.00以上 100.00未満	/	/	/	/	/	—	—	—	—	—	—	—
居住用不動産向け	0.00以上 0.10未満	/	/	/	/	/	—	—	—	—	—	—	—
	0.10以上 0.20未満	/	/	/	/	/	—	—	—	—	—	—	—
	0.20以上 1.00未満	/	/	/	/	/	0.24	0.30	3,265	2,916	13	—	0.36
	1.00以上 5.00未満	/	/	/	/	/	1.02	1.02	324	288	1	—	0.06
	5.00以上 100.00未満	/	/	/	/	/	25.88	20.14	138	106	25	—	20.14
その他リテール向け	0.00以上 0.10未満	/	/	/	/	/	—	—	—	—	—	—	—
	0.10以上 0.20未満	/	/	/	/	/	—	—	—	—	—	—	—
	0.20以上 1.00未満	/	/	/	/	/	0.31	0.40	4,228	3,852	18	—	0.39
	1.00以上 5.00未満	/	/	/	/	/	1.74	2.31	571	476	10	—	1.39
	5.00以上 100.00未満	/	/	/	/	/	23.10	23.40	138	100	46	—	24.02

注) 1. カウンターパーティ信用リスク、証券化エクスポージャー、信用リスク・アセットのみなし計算が適用されるエクスポージャーを除いています。  
 2. ソフリン向けエクスポージャー、金融機関等向けエクスポージャーは債務者が特定されることが想定されるため、また、事業法人向けエクスポージャー(特定貸付債権を除く)、特定貸付債権、株式等エクスポージャー、購入債権(事業法人等向け)は、それぞれのポートフォリオのデータをPD推計において個別に使用していないため、統合して事業法人等向けとして開示しています。購入債権(リテール向け)は、全体に占める割合が少ないため、購入した債権のポートフォリオ区分に応じてそれぞれ適格リボルビング型リテール向けエクスポージャー、居住用不動産向けエクスポージャー、その他リテール向けエクスポージャーに統合しています。  
 3. PD区分は集約した複数の内部格付のPD推計値の範囲を記載しています。  
 4. 先進的内部格付手法により算出した信用リスク・アセットのうち、各ポートフォリオが占める割合は以下の通りです。事業法人等向け68%、適格リボルビング型リテール向け0%、居住用不動産向け1%、その他リテール向け2%。  
 5. 債務者の数は、適格リボルビング型リテール向けエクスポージャー、居住用不動産向けエクスポージャー、その他リテール向けエクスポージャー(事業性と信を除く)においては、債権の数を開示しています。  
 6. バックテストの対象期間は2020年9月末~2021年9月末です。

(単位：%、件)

2022年度													
イ ポートフォリオ	ロ PD区分	ハ 相当する外部格付					ニ 加重平均PD (EAD加重)	ホ 相加平均PD	ヘ 債務者の数		ト 期中にデフォルトした 債務者の数	チ うち、期中に デフォルトした新たな 債務者の数	リ 過去の年平均 デフォルト率 (5年間)
		S&P	Moody's	Fitch	R&I	JCR			前期末	当期末			
		AAA~A-	Aaa~A3	AAA~A-	AAA~A-	AAA~A-							
事業法人等向け	0.00以上 0.10未満	AAA~A-	Aaa~A3	AAA~A-	AAA~A-	AAA~A-	0.04	0.05	548	571	—	—	—
	0.10以上 0.20未満	BBB+~ BBB-	Baa1~ Baa3	BBB+~ BBB-	BBB+~ BBB-	BBB+~ BBB-	0.13	0.13	120	110	—	—	—
	0.20以上 1.00未満	BB+~BB-	Ba1~Ba3	BB+~BB-	BB+~BB-	BB+~BB-	0.52	0.61	597	590	—	—	0.21
	1.00以上 5.00未満	B+~B-	B1~B3	B+~B-	B+~B-	B+~B-	2.13	2.15	570	526	—	—	0.21
	5.00以上 100.00未満	CCC+~ CCC-	Caa1~ Caa3	CCC+~ CCC-	CCC+~ CCC-	CCC+~ CCC-C	11.72	13.30	50	44	2	—	3.10
適格リボルビング型 リテール向け	0.00以上 0.10未満	/	/	/	/	/	—	—	—	—	—	—	—
	0.10以上 0.20未満	/	/	/	/	/	—	—	—	—	—	—	—
	0.20以上 1.00未満	/	/	/	/	/	—	—	—	—	—	—	—
	1.00以上 5.00未満	/	/	/	/	/	—	—	—	—	—	—	—
	5.00以上 100.00未満	/	/	/	/	/	—	—	—	—	—	—	—
居住用不動産向け	0.00以上 0.10未満	/	/	/	/	/	—	—	—	—	—	—	—
	0.10以上 0.20未満	/	/	/	/	/	—	—	—	—	—	—	—
	0.20以上 1.00未満	/	/	/	/	/	0.25	0.30	2,916	2,560	3	—	0.19
	1.00以上 5.00未満	/	/	/	/	/	1.05	1.05	288	259	—	—	0.07
	5.00以上 100.00未満	/	/	/	/	/	21.99	19.53	106	100	34	—	9.05
その他リテール向け	0.00以上 0.10未満	/	/	/	/	/	—	—	—	—	—	—	—
	0.10以上 0.20未満	/	/	/	/	/	—	—	—	—	—	—	—
	0.20以上 1.00未満	/	/	/	/	/	0.33	0.41	3,852	3,428	13	—	0.21
	1.00以上 5.00未満	/	/	/	/	/	1.72	2.30	476	379	2	—	0.87
	5.00以上 100.00未満	/	/	/	/	/	25.52	28.03	100	85	48	—	17.11

- 注) 1. カウンターパーティ信用リスク、証券化エクスポージャー、信用リスク・アセットのみなし計算が適用されるエクスポージャーを除いています。  
2. ソプリン向けエクスポージャー、金融機関等向けエクスポージャーは債務者が特定されることが想定されるため、また、事業法人向けエクスポージャー(特定貸付債権を除く)、特定貸付債権、株式等エクスポージャー、購入債権(事業法人等向け)は、それぞれのポートフォリオのデータをPD推計において個別に使用していないため、統合して事業法人等向けとして開示しています。購入債権(リテール向け)は、全体に占める割合が少ないため、購入した債権のポートフォリオ区分に応じてそれぞれ適格リボルビング型リテール向けエクスポージャー、居住用不動産向けエクスポージャー、その他リテール向けエクスポージャーに統合しています。  
3. PD区分は集約した複数の内部格付のPD推計値の範囲を記載しています。  
4. 先進的内部格付手法により算出した信用リスク・アセットのうち、各ポートフォリオが占める割合は以下の通りです。事業法人等向け75%、適格リボルビング型リテール向け0%、居住用不動産向け2%、その他リテール向け2%。  
5. 債務者の数は、適格リボルビング型リテール向けエクスポージャー、居住用不動産向けエクスポージャー、その他リテール向けエクスポージャー(事業性と信を除く)においては、債権の数を開示しています。  
6. バックテストの対象期間は2021年9月末~2022年9月末です。

みずほ信託銀行連結の自己資本の充実の状況

(D) CR10：内部格付手法－特定貸付債権(スロッシング・クライテリア方式)と株式等エクスポージャー(マーケット・ベース方式等)

(単位：百万円、%)

2021年度											
イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ	ト	チ	リ	ヌ	ル	ヲ
特定貸付債権(スロッシング・クライテリア方式)											
ボラティリティの高い事業用不動産向け貸付け(HVCRE)以外											
規制上の区分	残存期間	オン・バランスシートの額	オフ・バランスシートの額	リスク・ウェイト	エクスポージャーの額(EAD)					信用リスク・アセットの額	期待損失
					PF	OF	CF	IPRE	合計		
優(Strong)	2.5年未満	—	—	50%	—	—	—	—	—	—	—
	2.5年以上	—	—	70%	—	—	—	—	—	—	—
良(Good)	2.5年未満	—	—	70%	—	—	—	—	—	—	—
	2.5年以上	—	—	90%	—	—	—	—	—	—	—
可(Satisfactory)		—	—	115%	—	—	—	—	—	—	—
弱い(Weak)		—	—	250%	—	—	—	—	—	—	—
デフォルト(Default)		—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
合計		—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
ボラティリティの高い事業用不動産向け貸付け(HVCRE)											
規制上の区分	残存期間	オン・バランスシートの額	オフ・バランスシートの額	リスク・ウェイト		エクスポージャーの額(EAD)	信用リスク・アセットの額	期待損失			
優(Strong)	2.5年未満	—	—	70%		—	—	—			
	2.5年以上	—	—	95%		—	—	—			
良(Good)	2.5年未満	—	—	95%		—	—	—			
	2.5年以上	—	—	120%		—	—	—			
可(Satisfactory)		—	—	140%		—	—	—			
弱い(Weak)		—	—	250%		—	—	—			
デフォルト(Default)		—	—	—		—	—	—			
合計		—	—	—		—	—	—			
株式等エクスポージャー(マーケット・ベース方式等)											
マーケット・ベース方式が適用される株式等エクスポージャー											
カテゴリー	オン・バランスシートの額	オフ・バランスシートの額	リスク・ウェイト		エクスポージャーの額(EAD)	信用リスク・アセットの額	期待損失				
簡易手法－上場株式	8,046	—	300%		8,046	24,140					
簡易手法－非上場株式	28,755	470	400%		29,108	116,433					
内部モデル手法	—	—	—		—	—					
合計	36,802	470	—		37,155	140,574					
100%のリスク・ウェイトが適用される株式等エクスポージャー											
自己資本比率告示第166条第1項ただし書又は持株自己資本比率告示第144条第1項ただし書の定めるところにより100%のリスク・ウェイトが適用される株式等エクスポージャー	—	—	100%		—	—					

注) 1. カウンターパーティ信用リスク、証券化エクスポージャー、信用リスク・アセットのみなし計算が適用されるエクスポージャーを除いています。  
 2. PF、OF、CF、IPREは、それぞれプロジェクト・ファイナンス、オブジェクト・ファイナンス、コモディティ・ファイナンス、事業用不動産向け貸付けの略称です。

(単位：百万円、%)

2022年度											
イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ	ト	チ	リ	ヌ	ル	ヲ
特定貸付債権(スロッシング・クライテリア方式)											
ボラティリティの高い事業用不動産向け貸付け(HVCRE)以外											
規制上の区分	残存期間	オン・バ ランスシ ートの額	オフ・バ ランスシ ートの額	リスク・ ウェイト	エクスポージャーの額(EAD)					信用リスク・ アセットの額	期待損失
					PF	OF	CF	IPRE	合計		
優(Strong)	2.5年未満	—	—	50%	—	—	—	—	—	—	—
	2.5年以上	—	—	70%	—	—	—	—	—	—	—
良(Good)	2.5年未満	—	—	70%	—	—	—	—	—	—	—
	2.5年以上	—	—	90%	—	—	—	—	—	—	—
可(Satisfactory)		—	—	115%	—	—	—	—	—	—	—
弱い(Weak)		—	—	250%	—	—	—	—	—	—	—
デフォルト(Default)		—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
合計		—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
ボラティリティの高い事業用不動産向け貸付け(HVCRE)											
規制上の区分	残存期間	オン・バ ランスシ ートの額	オフ・バ ランスシ ートの額	リスク・ ウェイト	エクスポ ージャーの額 (EAD)	信用リスク・ アセットの額	期待損失				
優(Strong)	2.5年未満	—	—	70%		—	—				
	2.5年以上	—	—	95%		—	—				
良(Good)	2.5年未満	—	—	95%		—	—				
	2.5年以上	—	—	120%		—	—				
可(Satisfactory)		—	—	140%		—	—				
弱い(Weak)		—	—	250%		—	—				
デフォルト(Default)		—	—	—		—	—				
合計		—	—	—		—	—				
株式等エクスポージャー(マーケット・ベース方式等)											
マーケット・ベース方式が適用される株式等エクスポージャー											
カテゴリー	オン・バ ランスシ ートの額	オフ・バ ランスシ ートの額	リスク・ ウェイト	エクスポ ージャーの額 (EAD)	信用リスク・ アセットの額	期待損失					
簡易手法-上場株式	6,194	—	300%		6,194	18,582					
簡易手法-非上場株式	36,212	—	400%		36,212	144,850					
内部モデル手法	—	—	—		—	—					
合計	42,406	—	—		42,406	163,433					
100%のリスク・ウェイトが適用される株式等エクスポージャー											
自己資本比率告示第166条第1項ただし書又は持株自己資本比率告示第144条第1項ただし書の定めるところにより100%のリスク・ウェイトが適用される株式等エクスポージャー	—	—	100%		—	—					

注) 1. カウンターパーティ信用リスク、証券化エクスポージャー、信用リスク・アセットのみなし計算が適用されるエクスポージャーを除いています。  
2. PF、OF、CF、IPREは、それぞれプロジェクト・ファイナンス、オブジェクト・ファイナンス、コモディティ・ファイナンス、事業用不動産向け貸付けの略称です。

みずほ信託銀行連結の自己資本の充実の状況

(3) 標準的手法における信用リスク

(i) 標準的手法に関する定量的開示事項

(A) CR5：標準的手法－資産クラス及びリスク・ウェイト別の信用リスク・エクスポージャー

(単位：百万円)

項番	資産クラス	リスク・ウェイト	2021年度										合計	
			イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ	ト	チ	リ	ヌ		ル
			信用リスク・エクスポージャーの額(CCF・信用リスク削減手法適用後)											
			0%	10%	20%	35%	50%	75%	100%	150%	250%	1250%		
1	現金		1	-	-	-	-	-	-	-	-	-	1	
2	日本国政府及び日本銀行向け		11,015	-	-	-	-	-	-	-	-	-	11,015	
3	外国の中央政府及び中央銀行向け		34,503	-	-	-	-	-	-	-	-	-	34,503	
4	国際決済銀行等向け		-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
5	我が国の地方公共団体向け		212	-	-	-	-	-	-	-	-	-	212	
6	外国の中央政府等以外の公共部門向け		-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
7	国際開発銀行向け		-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
8	地方公共団体金融機構向け		-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
9	我が国の政府関係機関向け		-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
10	地方三公社向け		-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
11	金融機関及び第一種金融商品取引業者向け		-	-	111,646	-	632	-	2,586	-	-	-	114,864	
12	法人等向け		-	-	-	-	-	-	1,166	-	-	-	1,166	
13	中小企業等向け及び個人向け		-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
14	抵当権付住宅ローン		-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
15	不動産取得等事業向け		-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
16	三月以上延滞等(抵当権付住宅ローンを除く。)		-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
17	抵当権付住宅ローンに係る三月以上延滞		-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
18	取立未済手形		-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
19	信用保証協会等による保証付		-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
20	株式会社地域経済活性化支援機構等による保証付		-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
21	出資等(重要な出資を除く。)		-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
22	合計		45,731	-	111,646	-	632	-	3,752	-	-	-	161,763	

注) カウンターパーティ信用リスク、証券化取引に係る信用リスク及びリスク・ウェイトのみなし計算に係る信用リスクを除いています。

(単位：百万円)

項番	資産クラス	リスク・ ウェイト	2022年度										合計	
			イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ	ト	チ	リ	ヌ		ル
			信用リスク・エクスポージャーの額(CCF・信用リスク削減手法適用後)											
			0%	10%	20%	35%	50%	75%	100%	150%	250%	1250%		
1	現金		0	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0	
2	日本国政府及び日本銀行向け		11,712	-	-	-	-	-	-	-	-	-	11,712	
3	外国の中央政府及び中央銀行向け		41,607	-	-	-	-	-	-	-	-	-	41,607	
4	国際決済銀行等向け		-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
5	我が国の地方公共団体向け		0	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0	
6	外国の中央政府等以外の公共部門向け		-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
7	国際開発銀行向け		-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
8	地方公共団体金融機構向け		-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
9	我が国の政府関係機関向け		-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
10	地方三公社向け		-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
11	金融機関及び第一種金融商品取引業者向け		-	-	90,963	-	720	-	2,425	-	-	-	94,109	
12	法人等向け		-	-	-	-	-	-	1,116	-	-	-	1,116	
13	中小企業等向け及び個人向け		-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
14	抵当権付住宅ローン		-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
15	不動産取得等事業向け		-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
16	三月以上延滞等(抵当権付住宅ローンを除く。)		-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
17	抵当権付住宅ローンに係る三月以上延滞		-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
18	取立未済手形		-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
19	信用保証協会等による保証付		-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
20	株式会社地域経済活性化支援機構等による保証付		-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
21	出資等(重要な出資を除く。)		-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
22	合計		53,321	-	90,963	-	720	-	3,542	-	-	-	148,547	

注) カウンターパーティ信用リスク、証券化取引に係る信用リスク及びリスク・ウェイトのみなし計算に係る信用リスクを除いています。

みずほ信託銀行連結の自己資本の充実の状況

(4) 信用リスク削減手法

(i) 信用リスク削減手法に関する定量的開示事項

カウンターパーティ信用リスク、証券化エクスポージャー、信用リスク・アセットのみなし計算が適用されるエクスポージャーを除いています。

(A) CR3：信用リスク削減手法

(単位：百万円)

項番	2021年度					
	イ	ロ	ハ	ニ	ホ	
	非保全 エクスポージャー	保全された エクスポージャー	担保で保全された エクスポージャー	保証で保全された エクスポージャー	クレジット・デリバティブで保全された エクスポージャー	
1	貸出金	2,361,839	815,268	634,057	40,632	—
2	有価証券(負債性のもの)	32,038	86,309	66,089	—	—
3	その他オン・バランスシートの資産 (負債性のもの)	2,116,063	—	—	—	—
4	合計(1+2+3)	4,509,941	901,577	700,146	40,632	—
5	うちデフォルトしたもの	4,273	10,848	3,828	6,108	—

注) 1. その他オン・バランスシートの資産(うち負債性のもの)には預け金、コールローン、買入手形、買入金銭債権、金銭の信託、外国為替等が含まれます。  
2. うちデフォルトしたものには貸出条件緩和債権、3カ月以上延滞債権、破綻先債権等が含まれています。

(単位：百万円)

項番	2022年度					
	イ	ロ	ハ	ニ	ホ	
	非保全 エクスポージャー	保全された エクスポージャー	担保で保全された エクスポージャー	保証で保全された エクスポージャー	クレジット・デリバティブで保全された エクスポージャー	
1	貸出金	2,249,370	800,392	644,093	19,012	—
2	有価証券(負債性のもの)	34,752	65,699	50,468	—	—
3	その他オン・バランスシートの資産 (負債性のもの)	2,874,961	—	—	—	—
4	合計(1+2+3)	5,159,085	866,091	694,562	19,012	—
5	うちデフォルトしたもの	4,579	13,639	7,797	5,211	—

注) 1. その他オン・バランスシートの資産(うち負債性のもの)には預け金、コールローン、買入手形、買入金銭債権、金銭の信託、外国為替等が含まれます。  
2. うちデフォルトしたものには貸出条件緩和債権、3カ月以上延滞債権、破綻先債権等が含まれています。

## (B) CR4：標準的手法－信用リスク・エクスポージャーと信用リスク削減手法の効果

(単位：百万円、%)

項番	資産クラス	2021年度											
		イ		ロ		ハ		ニ		ホ		ヘ	
		CCF・信用リスク削減手法適用前のエクスポージャー		CCF・信用リスク削減手法適用後のエクスポージャー		信用リスク・アセットの額		リスク・ウェイトの加重平均値 (RWA density)					
		オン・バランスシートの額	オフ・バランスシートの額	オン・バランスシートの額	オフ・バランスシートの額	オン・バランスシートの額	オフ・バランスシートの額						
1	現金	1	—	1	—	—	—	—	—	—	—	0.00	
2	日本国政府及び日本銀行向け	11,015	—	11,015	—	—	—	—	—	—	—	0.00	
3	外国の中央政府及び中央銀行向け	34,503	—	34,503	—	—	—	—	—	—	—	0.00	
4	国際決済銀行等向け	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
5	我が国の地方公共団体向け	212	—	212	—	—	—	—	—	—	—	0.00	
6	外国の中央政府等以外の公共部門向け	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
7	国際開発銀行向け	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
8	地方公共団体金融機構向け	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
9	我が国の政府関係機関向け	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
10	地方三公社向け	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
11	金融機関及び第一種金融商品取引業者向け	114,864	—	114,864	—	25,231	—	21.96	—	—	—	—	
12	法人等向け	1,166	—	1,166	—	1,166	—	100.00	—	—	—	—	
13	中小企業等向け及び個人向け	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
14	抵当権付住宅ローン	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
15	不動産取得等事業向け	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
16	三月以上延滞等(抵当権付住宅ローンを除く。)	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
17	抵当権付住宅ローンに係る三月以上延滞	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
18	取立未済手形	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
19	信用保証協会等による保証付	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
20	株式会社地域経済活性化支援機構等による保証付	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
21	出資等(重要な出資を除く。)	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
22	合計	161,763	—	161,763	—	26,397	—	16.31	—	—	—	—	

(単位：百万円、%)

項番	資産クラス	2022年度											
		イ		ロ		ハ		ニ		ホ		ヘ	
		CCF・信用リスク削減手法適用前のエクスポージャー		CCF・信用リスク削減手法適用後のエクスポージャー		信用リスク・アセットの額		リスク・ウェイトの加重平均値 (RWA density)					
		オン・バランスシートの額	オフ・バランスシートの額	オン・バランスシートの額	オフ・バランスシートの額	オン・バランスシートの額	オフ・バランスシートの額						
1	現金	0	—	0	—	—	—	—	—	—	—	0.00	
2	日本国政府及び日本銀行向け	11,712	—	11,712	—	—	—	—	—	—	—	0.00	
3	外国の中央政府及び中央銀行向け	41,607	—	41,607	—	—	—	—	—	—	—	0.00	
4	国際決済銀行等向け	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
5	我が国の地方公共団体向け	0	—	0	—	—	—	—	—	—	—	0.00	
6	外国の中央政府等以外の公共部門向け	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
7	国際開発銀行向け	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
8	地方公共団体金融機構向け	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
9	我が国の政府関係機関向け	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
10	地方三公社向け	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
11	金融機関及び第一種金融商品取引業者向け	94,109	—	94,109	—	20,978	—	22.29	—	—	—	—	
12	法人等向け	1,116	—	1,116	—	1,116	—	100.00	—	—	—	—	
13	中小企業等向け及び個人向け	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
14	抵当権付住宅ローン	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
15	不動産取得等事業向け	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
16	三月以上延滞等(抵当権付住宅ローンを除く。)	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
17	抵当権付住宅ローンに係る三月以上延滞	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
18	取立未済手形	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
19	信用保証協会等による保証付	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
20	株式会社地域経済活性化支援機構等による保証付	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
21	出資等(重要な出資を除く。)	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
22	合計	148,547	—	148,547	—	22,095	—	14.87	—	—	—	—	

みずほ信託銀行連結の自己資本の充実の状況

(C) CR7：内部格付手法－信用リスク削減手法として用いられるクレジット・デリバティブが信用リスク・アセットの額に与える影響

(単位：百万円)

項番	ポートフォリオ	2021年度	
		イ	ロ
		クレジット・デリバティブ 勘案前の信用リス ク・アセットの額	実際の信用リスク・ アセットの額
1	ソブリン向けエクスポージャー -FIRB	—	—
2	ソブリン向けエクスポージャー -AIRB	980	980
3	金融機関等向けエクスポージャー -FIRB	—	—
4	金融機関等向けエクスポージャー -AIRB	20,837	20,837
5	事業法人向けエクスポージャー(特定貸付債権を除く。) -FIRB	—	—
6	事業法人向けエクスポージャー(特定貸付債権を除く。) -AIRB	579,052	579,052
7	特定貸付債権 -FIRB	—	—
8	特定貸付債権 -AIRB	145,109	145,109
9	リテール -適格リボルビング型リテール向けエクスポージャー	—	—
10	リテール -居住用不動産向けエクスポージャー	20,040	20,040
11	リテール -その他リテール向けエクスポージャー	31,460	31,460
12	株式 -FIRB	—	—
13	株式 -AIRB	186,538	186,538
14	購入債権 -FIRB	—	—
15	購入債権 -AIRB	2,900	2,900
16	合計	986,920	986,920

(単位：百万円)

項番	ポートフォリオ	2022年度	
		イ	ロ
		クレジット・デリバティブ 勘案前の信用リス ク・アセットの額	実際の信用リスク・ アセットの額
1	ソブリン向けエクスポージャー -FIRB	—	—
2	ソブリン向けエクスポージャー -AIRB	570	570
3	金融機関等向けエクスポージャー -FIRB	—	—
4	金融機関等向けエクスポージャー -AIRB	19,744	19,744
5	事業法人向けエクスポージャー(特定貸付債権を除く。) -FIRB	—	—
6	事業法人向けエクスポージャー(特定貸付債権を除く。) -AIRB	525,882	525,882
7	特定貸付債権 -FIRB	—	—
8	特定貸付債権 -AIRB	124,788	124,788
9	リテール -適格リボルビング型リテール向けエクスポージャー	—	—
10	リテール -居住用不動産向けエクスポージャー	18,212	18,212
11	リテール -その他リテール向けエクスポージャー	28,208	28,208
12	株式 -FIRB	—	—
13	株式 -AIRB	172,973	172,973
14	購入債権 -FIRB	—	—
15	購入債権 -AIRB	2,663	2,663
16	合計	893,043	893,043

### (5) 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が適用されるエクスポージャーの額

(単位：百万円)

	2021年度	2022年度
	期末残高	期末残高
ルック・スルー方式	36,025	37,750
マンドート方式	—	—
蓋然性方式250%	—	—
蓋然性方式400%	710	752
フォールバック方式1250%	199	226
<b>合計</b>	<b>36,935</b>	<b>38,729</b>

- 注) 1. ルック・スルー方式は、自己資本比率告示第76条の5第2項の規定により算出した割合をリスク・ウェイトとして用いるエクスポージャー又は同第167条第2項の規定により信用リスク・アセットの額を算出するエクスポージャーです。
2. マンドート方式は、自己資本比率告示第76条の5第6項の規定により算出した割合をリスク・ウェイトとして用いるエクスポージャー又は同第167条第7項の規定により信用リスク・アセットの額を算出するエクスポージャーです。
3. 蓋然性方式250%は、自己資本比率告示第76条の5第9項第1号に定める比率をリスク・ウェイトとして用いるエクスポージャー又は同第167条第10項第1号に定めるリスク・ウェイトを用いて信用リスク・アセットの額を算出するエクスポージャーです。
4. 蓋然性方式400%は、自己資本比率告示第76条の5第9項第2号に定める比率をリスク・ウェイトとして用いるエクスポージャー又は同第167条第10項第2号に定めるリスク・ウェイトを用いて信用リスク・アセットの額を算出するエクスポージャーです。
5. フォールバック方式1250%は、自己資本比率告示第76条の5第10項のリスク・ウェイトを用いるエクスポージャー又は同第167条第11項の規定により信用リスク・アセットの額を算出するエクスポージャーの額です。

みずほ信託銀行連結の自己資本の充実の状況

■カウンターパーティ信用リスク

(1) カウンターパーティ信用リスクに関する定量的開示事項

(A) CCR1：手法別のカウンターパーティ信用リスク・エクスポージャー額

(単位：百万円)

項番		2021年度					
		イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ
		RC	PFE	実効EPE	規制上のエクスポージャーの算定に使用される $\alpha$	信用リスク削減手法適用後のエクスポージャー	リスク・アセットの額
1	SA-CCR	—	—	/	1.4	—	—
	カレント・エクスポージャー方式	—	23	/	/	23	0
2	期待エクスポージャー方式	/	/	—	1.4	—	—
3	信用リスク削減手法における簡便手法	/	/	/	/	192	—
4	信用リスク削減手法における包括的手法	/	/	/	/	119,349	4
5	エクスポージャー変動推計モデル	/	/	/	/	—	—
6	合計	/	/	/	/	/	5

(単位：百万円)

項番		2022年度					
		イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ
		RC	PFE	実効EPE	規制上のエクスポージャーの算定に使用される $\alpha$	信用リスク削減手法適用後のエクスポージャー	リスク・アセットの額
1	SA-CCR	—	—	/	1.4	—	—
	カレント・エクスポージャー方式	—	49	/	/	49	1
2	期待エクスポージャー方式	/	/	—	1.4	—	—
3	信用リスク削減手法における簡便手法	/	/	/	/	190	—
4	信用リスク削減手法における包括的手法	/	/	/	/	75,762	9
5	エクスポージャー変動推計モデル	/	/	/	/	—	—
6	合計	/	/	/	/	/	10

(B) CCR2：CVAリスクに対する資本賦課

(単位：百万円)

項番		2021年度	
		イ	ロ
		信用リスク削減手法適用後のエクスポージャー	リスク・アセットの額(CVAリスク相当額を8%で除して得た額)
1	先進的リスク測定方式の対象となるポートフォリオの合計	—	—
2	(i) CVAバリュー・アット・リスクの額(乗数適用後)	/	—
3	(ii) CVAストレス・バリュー・アット・リスクの額(乗数適用後)	/	—
4	標準的リスク測定方式の対象となるポートフォリオの合計	—	—
5	CVAリスク相当額の対象となるポートフォリオの合計	—	—

(単位：百万円)

項番		2022年度	
		イ	ロ
		信用リスク削減手法適用後のエクスポージャー	リスク・アセットの額(CVAリスク相当額を8%で除して得た額)
1	先進的リスク測定方式の対象となるポートフォリオの合計	—	—
2	(i) CVAバリュー・アット・リスクの額(乗数適用後)	/	—
3	(ii) CVAストレス・バリュー・アット・リスクの額(乗数適用後)	/	—
4	標準的リスク測定方式の対象となるポートフォリオの合計	—	—
5	CVAリスク相当額の対象となるポートフォリオの合計	—	—

(C) CCR3：業種別及びリスク・ウェイト別のカウンターパーティ信用リスク・エクスポージャー (単位：百万円)

項番	業種	リスク・ウェイト	2021年度								合計	
			イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ	ト	チ		リ
			与信相当額(信用リスク削減効果勘案後)									
			0%	10%	20%	50%	75%	100%	150%	その他		
1	日本国政府及び日本銀行向け		192	—	—	—	—	—	—	—	192	
2	外国の中央政府及び中央銀行向け		—	—	—	—	—	—	—	—	—	
3	国際決済銀行等向け		—	—	—	—	—	—	—	—	—	
4	我が国の地方公共団体向け		—	—	—	—	—	—	—	—	—	
5	外国の中央政府等以外の公共部門向け		—	—	—	—	—	—	—	—	—	
6	国際開発銀行向け		—	—	—	—	—	—	—	—	—	
7	地方公共団体金融機構向け		—	—	—	—	—	—	—	—	—	
8	我が国の政府関係機関向け		—	—	—	—	—	—	—	—	—	
9	地方三公社向け		—	—	—	—	—	—	—	—	—	
10	金融機関及び第一種金融商品取引業者向け		—	—	—	—	—	—	—	—	—	
11	法人等向け		—	—	—	—	—	—	—	—	—	
12	中小企業等向け及び個人向け		—	—	—	—	—	—	—	—	—	
13	上記以外		—	—	—	—	—	—	—	—	—	
14	合計		192	—	—	—	—	—	—	—	192	

(単位：百万円)

項番	業種	リスク・ウェイト	2022年度								合計	
			イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ	ト	チ		リ
			与信相当額(信用リスク削減効果勘案後)									
			0%	10%	20%	50%	75%	100%	150%	その他		
1	日本国政府及び日本銀行向け		190	—	—	—	—	—	—	—	190	
2	外国の中央政府及び中央銀行向け		—	—	—	—	—	—	—	—	—	
3	国際決済銀行等向け		—	—	—	—	—	—	—	—	—	
4	我が国の地方公共団体向け		—	—	—	—	—	—	—	—	—	
5	外国の中央政府等以外の公共部門向け		—	—	—	—	—	—	—	—	—	
6	国際開発銀行向け		—	—	—	—	—	—	—	—	—	
7	地方公共団体金融機構向け		—	—	—	—	—	—	—	—	—	
8	我が国の政府関係機関向け		—	—	—	—	—	—	—	—	—	
9	地方三公社向け		—	—	—	—	—	—	—	—	—	
10	金融機関及び第一種金融商品取引業者向け		—	—	—	—	—	—	—	—	—	
11	法人等向け		—	—	—	—	—	—	—	—	—	
12	中小企業等向け及び個人向け		—	—	—	—	—	—	—	—	—	
13	上記以外		—	—	—	—	—	—	—	—	—	
14	合計		190	—	—	—	—	—	—	—	190	

## みずほ信託銀行連結の自己資本の充実の状況

## (D) CCR4：内部格付手法－ポートフォリオ別及びPD区分別のカウンターパーティ信用リスク・エクスポージャー

(単位：百万円、%、千件、年)

項番	PD区分	2021年度						
		イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ	ト
		EAD(信用リスク削減効果勘案後)	平均PD	取引相手方の数	平均LGD	平均残存期間	信用リスク・アセット	リスク・ウェイトの加重平均値(RWA density)
<b>ソブリン向けエクスポージャー</b>								
1	0.00 以上0.15 未満	119,264	0.00	0.0	37.61	1.0	0	0.00
2	0.15 以上0.25 未満	—	—	—	—	—	—	—
3	0.25 以上0.50 未満	—	—	—	—	—	—	—
4	0.50 以上0.75 未満	—	—	—	—	—	—	—
5	0.75 以上2.50 未満	—	—	—	—	—	—	—
6	2.50 以上10.00 未満	—	—	—	—	—	—	—
7	10.00 以上100.00 未満	—	—	—	—	—	—	—
8	100.00(デフォルト)	—	—	—	—	—	—	—
9	小計	119,264	0.00	0.0	37.61	1.0	0	0.00
<b>金融機関等向けエクスポージャー</b>								
1	0.00 以上0.15 未満	85	0.03	0.0	37.61	0.4	4	5.49
2	0.15 以上0.25 未満	—	—	—	—	—	—	—
3	0.25 以上0.50 未満	—	—	—	—	—	—	—
4	0.50 以上0.75 未満	—	—	—	—	—	—	—
5	0.75 以上2.50 未満	—	—	—	—	—	—	—
6	2.50 以上10.00 未満	—	—	—	—	—	—	—
7	10.00 以上100.00 未満	—	—	—	—	—	—	—
8	100.00(デフォルト)	—	—	—	—	—	—	—
9	小計	85	0.03	0.0	37.61	0.4	4	5.49
<b>事業法人向けエクスポージャー(中堅中小企業向けエクスポージャー及び特定貸付債権を除く。)</b>								
1	0.00 以上0.15 未満	23	0.03	0.0	37.61	0.0	0	3.51
2	0.15 以上0.25 未満	—	—	—	—	—	—	—
3	0.25 以上0.50 未満	—	—	—	—	—	—	—
4	0.50 以上0.75 未満	—	—	—	—	—	—	—
5	0.75 以上2.50 未満	—	—	—	—	—	—	—
6	2.50 以上10.00 未満	—	—	—	—	—	—	—
7	10.00 以上100.00 未満	—	—	—	—	—	—	—
8	100.00(デフォルト)	—	—	—	—	—	—	—
9	小計	23	0.03	0.0	37.61	0.0	0	3.51
<b>中堅中小企業向けエクスポージャー</b>								
1	0.00 以上0.15 未満	—	—	—	—	—	—	—
2	0.15 以上0.25 未満	—	—	—	—	—	—	—
3	0.25 以上0.50 未満	—	—	—	—	—	—	—
4	0.50 以上0.75 未満	—	—	—	—	—	—	—
5	0.75 以上2.50 未満	—	—	—	—	—	—	—
6	2.50 以上10.00 未満	—	—	—	—	—	—	—
7	10.00 以上100.00 未満	—	—	—	—	—	—	—
8	100.00(デフォルト)	—	—	—	—	—	—	—
9	小計	—	—	—	—	—	—	—
<b>特定貸付債権</b>								
1	0.00 以上0.15 未満	—	—	—	—	—	—	—
2	0.15 以上0.25 未満	—	—	—	—	—	—	—
3	0.25 以上0.50 未満	—	—	—	—	—	—	—
4	0.50 以上0.75 未満	—	—	—	—	—	—	—
5	0.75 以上2.50 未満	—	—	—	—	—	—	—
6	2.50 以上10.00 未満	—	—	—	—	—	—	—
7	10.00 以上100.00 未満	—	—	—	—	—	—	—
8	100.00(デフォルト)	—	—	—	—	—	—	—
9	小計	—	—	—	—	—	—	—

(次ページへ続く)

(続き)

(単位：百万円、%、千件、年)

項番	PD区分	2021年度						
		イ EAD(信用リ スク削減効果 勘案後)	ロ 平均PD	ハ 取引相手方の数	ニ 平均LGD	ホ 平均残存期間	ヘ 信用リスク・アセット	ト リスク・ウェイトの 加重平均値 (RWA density)
<b>購入債券</b>								
1	0.00 以上0.15 未満	—	—	—	—	—	—	—
2	0.15 以上0.25 未満	—	—	—	—	—	—	—
3	0.25 以上0.50 未満	—	—	—	—	—	—	—
4	0.50 以上0.75 未満	—	—	—	—	—	—	—
5	0.75 以上2.50 未満	—	—	—	—	—	—	—
6	2.50 以上10.00 未満	—	—	—	—	—	—	—
7	10.00 以上100.00 未満	—	—	—	—	—	—	—
8	100.00(デフォルト)	—	—	—	—	—	—	—
9	小計	—	—	—	—	—	—	—
<b>リテール向けエクスポージャー</b>								
1	0.00 以上0.15 未満	—	—	—	—	/	—	—
2	0.15 以上0.25 未満	—	—	—	—	/	—	—
3	0.25 以上0.50 未満	—	—	—	—	/	—	—
4	0.50 以上0.75 未満	—	—	—	—	/	—	—
5	0.75 以上2.50 未満	—	—	—	—	/	—	—
6	2.50 以上10.00 未満	—	—	—	—	/	—	—
7	10.00 以上100.00 未満	—	—	—	—	/	—	—
8	100.00(デフォルト)	—	—	—	—	/	—	—
9	小計	—	—	—	—	/	—	—
<b>合計(全てのポートフォリオ)</b>		<b>119,373</b>	<b>0.00</b>	<b>0.0</b>	<b>37.61</b>	<b>0.9</b>	<b>5</b>	<b>0.00</b>

みずほ信託銀行連結の自己資本の充実の状況

(単位：百万円、%、千件、年)

		2022年度						
		イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ	ト
項番	PD区分	EAD(信用リスク削減効果勘案後)	平均PD	取引相手方の数	平均LGD	平均残存期間	信用リスク・アセット	リスク・ウェイトの加重平均値(RWA density)
<b>ソブリン向けエクスポージャー</b>								
1	0.00 以上0.15 未満	75,544	0.00	0.0	37.03	1.0	0	0.00
2	0.15 以上0.25 未満	—	—	—	—	—	—	—
3	0.25 以上0.50 未満	—	—	—	—	—	—	—
4	0.50 以上0.75 未満	—	—	—	—	—	—	—
5	0.75 以上2.50 未満	—	—	—	—	—	—	—
6	2.50 以上10.00 未満	—	—	—	—	—	—	—
7	10.00 以上100.00 未満	—	—	—	—	—	—	—
8	100.00(デフォルト)	—	—	—	—	—	—	—
9	小計	75,544	0.00	0.0	37.03	1.0	0	0.00
<b>金融機関等向けエクスポージャー</b>								
1	0.00 以上0.15 未満	217	0.03	0.0	37.03	0.1	9	4.24
2	0.15 以上0.25 未満	—	—	—	—	—	—	—
3	0.25 以上0.50 未満	—	—	—	—	—	—	—
4	0.50 以上0.75 未満	—	—	—	—	—	—	—
5	0.75 以上2.50 未満	—	—	—	—	—	—	—
6	2.50 以上10.00 未満	—	—	—	—	—	—	—
7	10.00 以上100.00 未満	—	—	—	—	—	—	—
8	100.00(デフォルト)	—	—	—	—	—	—	—
9	小計	217	0.03	0.0	37.03	0.1	9	4.24
<b>事業法人向けエクスポージャー(中堅中小企業向けエクスポージャー及び特定貸付債権を除く。)</b>								
1	0.00 以上0.15 未満	49	0.03	0.0	37.03	0.0	1	3.46
2	0.15 以上0.25 未満	—	—	—	—	—	—	—
3	0.25 以上0.50 未満	—	—	—	—	—	—	—
4	0.50 以上0.75 未満	—	—	—	—	—	—	—
5	0.75 以上2.50 未満	—	—	—	—	—	—	—
6	2.50 以上10.00 未満	—	—	—	—	—	—	—
7	10.00 以上100.00 未満	—	—	—	—	—	—	—
8	100.00(デフォルト)	—	—	—	—	—	—	—
9	小計	49	0.03	0.0	37.03	0.0	1	3.46
<b>中堅中小企業向けエクスポージャー</b>								
1	0.00 以上0.15 未満	—	—	—	—	—	—	—
2	0.15 以上0.25 未満	—	—	—	—	—	—	—
3	0.25 以上0.50 未満	—	—	—	—	—	—	—
4	0.50 以上0.75 未満	—	—	—	—	—	—	—
5	0.75 以上2.50 未満	—	—	—	—	—	—	—
6	2.50 以上10.00 未満	—	—	—	—	—	—	—
7	10.00 以上100.00 未満	—	—	—	—	—	—	—
8	100.00(デフォルト)	—	—	—	—	—	—	—
9	小計	—	—	—	—	—	—	—
<b>特定貸付債権</b>								
1	0.00 以上0.15 未満	—	—	—	—	—	—	—
2	0.15 以上0.25 未満	—	—	—	—	—	—	—
3	0.25 以上0.50 未満	—	—	—	—	—	—	—
4	0.50 以上0.75 未満	—	—	—	—	—	—	—
5	0.75 以上2.50 未満	—	—	—	—	—	—	—
6	2.50 以上10.00 未満	—	—	—	—	—	—	—
7	10.00 以上100.00 未満	—	—	—	—	—	—	—
8	100.00(デフォルト)	—	—	—	—	—	—	—
9	小計	—	—	—	—	—	—	—

(次ページへ続く)

(続き)

(単位：百万円、%、千件、年)

項番	PD区分	2022年度						
		イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ	ト
		EAD(信用リスク削減効果勘案後)	平均PD	取引相手方の数	平均LGD	平均残存期間	信用リスク・アセット	リスク・ウェイトの加重平均値 (RWA density)
<b>購入債券</b>								
1	0.00 以上0.15 未満	—	—	—	—	—	—	
2	0.15 以上0.25 未満	—	—	—	—	—	—	
3	0.25 以上0.50 未満	—	—	—	—	—	—	
4	0.50 以上0.75 未満	—	—	—	—	—	—	
5	0.75 以上2.50 未満	—	—	—	—	—	—	
6	2.50 以上10.00 未満	—	—	—	—	—	—	
7	10.00 以上100.00 未満	—	—	—	—	—	—	
8	100.00(デフォルト)	—	—	—	—	—	—	
9	小計	—	—	—	—	—	—	
<b>リテール向けエクスポージャー</b>								
1	0.00 以上0.15 未満	—	—	—	—	/	—	
2	0.15 以上0.25 未満	—	—	—	—	/	—	
3	0.25 以上0.50 未満	—	—	—	—	/	—	
4	0.50 以上0.75 未満	—	—	—	—	/	—	
5	0.75 以上2.50 未満	—	—	—	—	/	—	
6	2.50 以上10.00 未満	—	—	—	—	/	—	
7	10.00 以上100.00 未満	—	—	—	—	/	—	
8	100.00(デフォルト)	—	—	—	—	/	—	
9	小計	—	—	—	—	/	—	
合計(全てのポートフォリオ)		75,811	0.00	0.0	37.03	0.9	10	0.01

## (E) CCR5：担保の内訳

(単位：百万円)

項番	2021年度						
	イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ	
	派生商品取引で使用される担保				レボ形式の取引で使用される担保		
	受入担保の公正価値		差入担保の公正価値		受入担保の公正価値	差入担保の公正価値	
分別管理されている	分別管理されていない	分別管理されている	分別管理されていない				
1	現金(国内通貨)	—	9,080	10,000	—	—	
2	現金(外国通貨)	—	—	—	—	—	
3	国内ソブリン債	—	—	—	19,961	—	
4	その他ソブリン債	—	—	—	—	—	
5	政府関係機関債	—	—	—	—	—	
6	社債	—	—	—	—	—	
7	株式	—	—	—	—	—	
8	その他担保	—	—	—	—	119,264	
9	合計	—	9,080	10,000	—	19,961	119,264

(単位：百万円)

項番	2022年度						
	イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ	
	派生商品取引で使用される担保				レボ形式の取引で使用される担保		
	受入担保の公正価値		差入担保の公正価値		受入担保の公正価値	差入担保の公正価値	
分別管理されている	分別管理されていない	分別管理されている	分別管理されていない				
1	現金(国内通貨)	—	13,415	16,500	—	—	
2	現金(外国通貨)	—	—	—	—	—	
3	国内ソブリン債	—	—	—	19,960	—	
4	その他ソブリン債	—	—	—	—	—	
5	政府関係機関債	—	—	—	—	—	
6	社債	—	—	—	—	—	
7	株式	—	—	—	—	—	
8	その他担保	—	—	—	—	75,544	
9	合計	—	13,415	16,500	—	19,960	75,544

## みずほ信託銀行連結の自己資本の充実の状況

## (F) CCR6：クレジット・デリバティブ取引のエクスポージャー

(単位：百万円)

項番		2021年度	
		イ	ロ
		購入したプロテクション	提供したプロテクション
<b>想定元本</b>			
1	シングルネーム・クレジット・デフォルト・スワップ	—	—
2	インデックス・クレジット・デフォルト・スワップ	—	—
3	トータル・リターン・スワップ	—	—
4	クレジットオプション	—	—
5	その他のクレジット・デリバティブ	—	—
6	<b>想定元本合計</b>	—	—
<b>公正価値</b>			
7	プラスの公正価値(資産)	—	—
8	マイナスの公正価値(負債)	—	—

(単位：百万円)

項番		2022年度	
		イ	ロ
		購入したプロテクション	提供したプロテクション
<b>想定元本</b>			
1	シングルネーム・クレジット・デフォルト・スワップ	—	—
2	インデックス・クレジット・デフォルト・スワップ	—	—
3	トータル・リターン・スワップ	—	—
4	クレジットオプション	—	—
5	その他のクレジット・デリバティブ	—	—
6	<b>想定元本合計</b>	—	—
<b>公正価値</b>			
7	プラスの公正価値(資産)	—	—
8	マイナスの公正価値(負債)	—	—

## (G) CCR7：期待エクスポージャー方式を用いたカウンターパーティ信用リスク・エクスポージャーのリスク・アセット変動表

当行グループのデリバティブ業務の縮小に伴い、2021年3月以降、デリバティブ取引のEAD算出方式を期待エクスポージャー方式からカレントエクスポージャー方式に移行しております。

## (H) CCR8：中央清算機関向けエクスポージャー

(単位：百万円)

項番		2021年度	
		イ	ロ
		中央清算機関向け エクスポージャー (信用リスク削減手法適用後)	リスク・アセットの額
1	適格中央清算機関へのエクスポージャー(合計)	/	309
2	適格中央清算機関に対するトレード・エクスポージャー(当初証拠金を除く。)	15,464	309
3	(i) 派生商品取引(上場以外)	15,464	309
4	(ii) 派生商品取引(上場)	—	—
5	(iii) レボ形式の取引	—	—
6	(iv) クロスプロダクト・ネットtingが承認された場合のネットting・セット	—	—
7	分別管理されている当初証拠金	10,000	/
8	分別管理されていない当初証拠金	—	—
9	事前拋出された清算基金	—	—
10	未拋出の清算基金	—	—
11	非適格中央清算機関へのエクスポージャー(合計)	/	—
12	非適格中央清算機関に対するトレード・エクスポージャー(当初証拠金を除く。)	—	—
13	(i) 派生商品取引(上場以外)	—	—
14	(ii) 派生商品取引(上場)	—	—
15	(iii) レボ形式の取引	—	—
16	(iv) クロスプロダクト・ネットtingが承認された場合のネットting・セット	—	—
17	分別管理されている当初証拠金	—	/
18	分別管理されていない当初証拠金	—	—
19	事前拋出された清算基金	—	—
20	未拋出の清算基金	—	—

(単位：百万円)

項番		2022年度	
		イ	ロ
		中央清算機関向け エクスポージャー (信用リスク削減手法適用後)	リスク・アセットの額
1	適格中央清算機関へのエクスポージャー(合計)	/	899
2	適格中央清算機関に対するトレード・エクスポージャー(当初証拠金を除く。)	28,476	569
3	(i) 派生商品取引(上場以外)	28,476	569
4	(ii) 派生商品取引(上場)	—	—
5	(iii) レボ形式の取引	—	—
6	(iv) クロスプロダクト・ネットtingが承認された場合のネットting・セット	—	—
7	分別管理されている当初証拠金	16,500	/
8	分別管理されていない当初証拠金	16,500	330
9	事前拋出された清算基金	—	—
10	未拋出の清算基金	—	—
11	非適格中央清算機関へのエクスポージャー(合計)	/	—
12	非適格中央清算機関に対するトレード・エクスポージャー(当初証拠金を除く。)	—	—
13	(i) 派生商品取引(上場以外)	—	—
14	(ii) 派生商品取引(上場)	—	—
15	(iii) レボ形式の取引	—	—
16	(iv) クロスプロダクト・ネットtingが承認された場合のネットting・セット	—	—
17	分別管理されている当初証拠金	—	/
18	分別管理されていない当初証拠金	—	—
19	事前拋出された清算基金	—	—
20	未拋出の清算基金	—	—

みずほ信託銀行連結の自己資本の充実の状況

■証券化エクスポージャー

(1) 証券化エクスポージャーに関する定量的開示事項

(A) SEC1：原資産の種類別の証券化エクスポージャー（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）

(単位：百万円)

		2021年度								
項番	原資産の種類	イ ロ ハ			ニ ホ ヘ			ト チ リ		
		自金融機関がオリジネーター			自金融機関がスポンサー			自金融機関が投資家		
		資産譲渡型 証券化取引	合成型 証券化取引	小計	資産譲渡型 証券化取引	合成型 証券化取引	小計	資産譲渡型 証券化取引	合成型 証券化取引	小計
1	リテール(合計)	—	—	—	1,500	—	1,500	3,047	—	3,047
2	担保付住宅ローン	—	—	—	—	—	—	3,047	—	3,047
3	クレジットカード債権	—	—	—	1,500	—	1,500	—	—	—
4	その他リテールに係るエクスポージャー	—	—	—	—	—	—	—	—	—
5	再証券化	—	—	—	—	—	—	—	—	—
6	ホールセール(合計)	—	—	—	—	—	—	—	—	—
7	事業法人向けローン	—	—	—	—	—	—	—	—	—
8	商業用モーゲージ担保証券	—	—	—	—	—	—	—	—	—
9	リース債権及び売掛債権	—	—	—	—	—	—	—	—	—
10	その他のホールセール	—	—	—	—	—	—	—	—	—
11	再証券化	—	—	—	—	—	—	—	—	—

(単位：百万円)

		2022年度								
項番	原資産の種類	イ ロ ハ			ニ ホ ヘ			ト チ リ		
		自金融機関がオリジネーター			自金融機関がスポンサー			自金融機関が投資家		
		資産譲渡型 証券化取引	合成型 証券化取引	小計	資産譲渡型 証券化取引	合成型 証券化取引	小計	資産譲渡型 証券化取引	合成型 証券化取引	小計
1	リテール(合計)	—	—	—	1,500	—	1,500	2,515	—	2,515
2	担保付住宅ローン	—	—	—	—	—	—	2,515	—	2,515
3	クレジットカード債権	—	—	—	1,500	—	1,500	—	—	—
4	その他リテールに係るエクスポージャー	—	—	—	—	—	—	—	—	—
5	再証券化	—	—	—	—	—	—	—	—	—
6	ホールセール(合計)	—	—	—	—	—	—	—	—	—
7	事業法人向けローン	—	—	—	—	—	—	—	—	—
8	商業用モーゲージ担保証券	—	—	—	—	—	—	—	—	—
9	リース債権及び売掛債権	—	—	—	—	—	—	—	—	—
10	その他のホールセール	—	—	—	—	—	—	—	—	—
11	再証券化	—	—	—	—	—	—	—	—	—

(B) SEC2：原資産の種類別の証券化エクスポージャー（マーケット・リスク相当額の算出対象となっている証券化エクスポージャー）

（単位：百万円）

		2021年度								
		イ ロ ハ			ニ ホ ヘ			ト チ リ		
		自金融機関がオリジネーター			自金融機関がスポンサー			自金融機関が投資家		
項番	原資産の種類	資産譲渡型証券化取引	合成型証券化取引	小計	資産譲渡型証券化取引	合成型証券化取引	小計	資産譲渡型証券化取引	合成型証券化取引	小計
1	リート(合計)	—	—	—	—	—	—	—	—	—
2	担保付住宅ローン	—	—	—	—	—	—	—	—	—
3	クレジットカード債権	—	—	—	—	—	—	—	—	—
4	その他リートに係るエクスポージャー	—	—	—	—	—	—	—	—	—
5	再証券化	—	—	—	—	—	—	—	—	—
6	ホールセール(合計)	—	—	—	—	—	—	—	—	—
7	事業法人向けローン	—	—	—	—	—	—	—	—	—
8	商業用モーゲージ担保証券	—	—	—	—	—	—	—	—	—
9	リース債権及び売掛債権	—	—	—	—	—	—	—	—	—
10	その他のホールセール	—	—	—	—	—	—	—	—	—
11	再証券化	—	—	—	—	—	—	—	—	—

（単位：百万円）

		2022年度								
		イ ロ ハ			ニ ホ ヘ			ト チ リ		
		自金融機関がオリジネーター			自金融機関がスポンサー			自金融機関が投資家		
項番	原資産の種類	資産譲渡型証券化取引	合成型証券化取引	小計	資産譲渡型証券化取引	合成型証券化取引	小計	資産譲渡型証券化取引	合成型証券化取引	小計
1	リート(合計)	—	—	—	—	—	—	—	—	—
2	担保付住宅ローン	—	—	—	—	—	—	—	—	—
3	クレジットカード債権	—	—	—	—	—	—	—	—	—
4	その他リートに係るエクスポージャー	—	—	—	—	—	—	—	—	—
5	再証券化	—	—	—	—	—	—	—	—	—
6	ホールセール(合計)	—	—	—	—	—	—	—	—	—
7	事業法人向けローン	—	—	—	—	—	—	—	—	—
8	商業用モーゲージ担保証券	—	—	—	—	—	—	—	—	—
9	リース債権及び売掛債権	—	—	—	—	—	—	—	—	—
10	その他のホールセール	—	—	—	—	—	—	—	—	—
11	再証券化	—	—	—	—	—	—	—	—	—

みずほ信託銀行連結の自己資本の充実の状況

(C) SEC3：信用リスク・アセットの額の算出対象となる証券化エクスポージャー及び関連する所要自己資本  
(オリジネーター又はスポンサーである場合)

(単位：百万円)

		2021年度							
		イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ	ト	チ
項番	合計	資産譲渡型 証券化取引 (小計)	証券化			再証券化			
			裏付けとなる リート	ホールセール	再証券化		シニア	非シニア	
					裏付けとなる リート	ホールセール			
<b>エクスポージャーの額(リスク・ウェイト区分別)</b>									
1	20%以下のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	1,500	1,500	1,500	1,500	—	—	—	—
2	20%超50%以下のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	—	—	—	—	—	—	—	—
3	50%超100%以下のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	—	—	—	—	—	—	—	—
4	100%超1250%未満のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	—	—	—	—	—	—	—	—
5	1250%のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	—	—	—	—	—	—	—	—
<b>エクスポージャーの額(算出方法別)</b>									
6	内部格付手法準拠方式又は内部評価方式が適用される証券化エクスポージャー	1,500	1,500	1,500	1,500	—	—	—	—
7	外部格付準拠方式が適用される証券化エクスポージャー	—	—	—	—	—	—	—	—
8	標準的手法準拠方式が適用される証券化エクスポージャー	—	—	—	—	—	—	—	—
9	1250%のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	—	—	—	—	—	—	—	—
<b>信用リスク・アセットの額(算出方法別)</b>									
10	内部格付手法準拠方式又は内部評価方式により算出した信用リスク・アセット	260	260	260	260	—	—	—	—
11	外部格付準拠方式により算出した信用リスク・アセット	—	—	—	—	—	—	—	—
12	標準的手法準拠方式により算出した信用リスク・アセット	—	—	—	—	—	—	—	—
13	1250%のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャーに係る信用リスク・アセット	—	—	—	—	—	—	—	—
<b>所要自己資本の額(算出方法別)</b>									
14	内部格付手法準拠方式又は内部評価方式が適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本	20	20	20	20	—	—	—	—
15	外部格付準拠方式が適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本	—	—	—	—	—	—	—	—
16	標準的手法準拠方式が適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本	—	—	—	—	—	—	—	—
17	1250%のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本	—	—	—	—	—	—	—	—

		2021年度							
		リ	ヌ	ル	ヲ	ワ	カ	ヨ	
項番	合計	合成型証券 化取引 (小計)	証券化			再証券化			
			裏付けとなる リート	ホールセール	再証券化		シニア	非シニア	
					裏付けとなる リート	ホールセール			
<b>エクスポージャーの額(リスク・ウェイト区分別)</b>									
1	20%以下のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	—	—	—	—	—	—	—	—
2	20%超50%以下のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	—	—	—	—	—	—	—	—
3	50%超100%以下のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	—	—	—	—	—	—	—	—
4	100%超1250%未満のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	—	—	—	—	—	—	—	—
5	1250%のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	—	—	—	—	—	—	—	—
<b>エクスポージャーの額(算出方法別)</b>									
6	内部格付手法準拠方式又は内部評価方式が適用される証券化エクスポージャー	—	—	—	—	—	—	—	—
7	外部格付準拠方式が適用される証券化エクスポージャー	—	—	—	—	—	—	—	—
8	標準的手法準拠方式が適用される証券化エクスポージャー	—	—	—	—	—	—	—	—
9	1250%のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	—	—	—	—	—	—	—	—
<b>信用リスク・アセットの額(算出方法別)</b>									
10	内部格付手法準拠方式又は内部評価方式により算出した信用リスク・アセット	—	—	—	—	—	—	—	—
11	外部格付準拠方式により算出した信用リスク・アセット	—	—	—	—	—	—	—	—
12	標準的手法準拠方式により算出した信用リスク・アセット	—	—	—	—	—	—	—	—
13	1250%のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャーに係る信用リスク・アセット	—	—	—	—	—	—	—	—
<b>所要自己資本の額(算出方法別)</b>									
14	内部格付手法準拠方式又は内部評価方式が適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本	—	—	—	—	—	—	—	—
15	外部格付準拠方式が適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本	—	—	—	—	—	—	—	—
16	標準的手法準拠方式が適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本	—	—	—	—	—	—	—	—
17	1250%のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本	—	—	—	—	—	—	—	—

(単位：百万円)

		2022年度							
		イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ	ト	チ
		合計		証券化			再証券化		
項番		資産譲渡型 証券化取引 (小計)	裏付けとなる ホールセール リート					シニア	非シニア
<b>エクスポージャーの額(リスク・ウェイト区分別)</b>									
1	20%以下のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	1,500	1,500	1,500	1,500	—	—	—	—
2	20%超50%以下のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	—	—	—	—	—	—	—	—
3	50%超100%以下のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	—	—	—	—	—	—	—	—
4	100%超1250%未満のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	—	—	—	—	—	—	—	—
5	1250%のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	—	—	—	—	—	—	—	—
<b>エクスポージャーの額(算出方法別)</b>									
6	内部格付手法準拠方式又は内部評価方式が適用される証券化エクスポージャー	1,500	1,500	1,500	1,500	—	—	—	—
7	外部格付準拠方式が適用される証券化エクスポージャー	—	—	—	—	—	—	—	—
8	標準的手法準拠方式が適用される証券化エクスポージャー	—	—	—	—	—	—	—	—
9	1250%のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	—	—	—	—	—	—	—	—
<b>信用リスク・アセットの額(算出方法別)</b>									
10	内部格付手法準拠方式又は内部評価方式により算出した信用リスク・アセット	225	225	225	225	—	—	—	—
11	外部格付準拠方式により算出した信用リスク・アセット	—	—	—	—	—	—	—	—
12	標準的手法準拠方式により算出した信用リスク・アセット	—	—	—	—	—	—	—	—
13	1250%のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャーに係る信用リスク・アセット	—	—	—	—	—	—	—	—
<b>所要自己資本の額(算出方法別)</b>									
14	内部格付手法準拠方式又は内部評価方式が適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本	18	18	18	18	—	—	—	—
15	外部格付準拠方式が適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本	—	—	—	—	—	—	—	—
16	標準的手法準拠方式が適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本	—	—	—	—	—	—	—	—
17	1250%のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本	—	—	—	—	—	—	—	—

		2022年度								
		リ	ヌ	ル	ヲ	ワ	カ	ヨ		
		合成型証券 化取引 (小計)		証券化			再証券化			
項番		裏付けとなる リート		ホールセール			シニア			非シニア
<b>エクスポージャーの額(リスク・ウェイト区分別)</b>										
1	20%以下のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	—	—	—	—	—	—	—	—	
2	20%超50%以下のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	—	—	—	—	—	—	—	—	
3	50%超100%以下のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	—	—	—	—	—	—	—	—	
4	100%超1250%未満のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	—	—	—	—	—	—	—	—	
5	1250%のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	—	—	—	—	—	—	—	—	
<b>エクスポージャーの額(算出方法別)</b>										
6	内部格付手法準拠方式又は内部評価方式が適用される証券化エクスポージャー	—	—	—	—	—	—	—	—	
7	外部格付準拠方式が適用される証券化エクスポージャー	—	—	—	—	—	—	—	—	
8	標準的手法準拠方式が適用される証券化エクスポージャー	—	—	—	—	—	—	—	—	
9	1250%のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	—	—	—	—	—	—	—	—	
<b>信用リスク・アセットの額(算出方法別)</b>										
10	内部格付手法準拠方式又は内部評価方式により算出した信用リスク・アセット	—	—	—	—	—	—	—	—	
11	外部格付準拠方式により算出した信用リスク・アセット	—	—	—	—	—	—	—	—	
12	標準的手法準拠方式により算出した信用リスク・アセット	—	—	—	—	—	—	—	—	
13	1250%のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャーに係る信用リスク・アセット	—	—	—	—	—	—	—	—	
<b>所要自己資本の額(算出方法別)</b>										
14	内部格付手法準拠方式又は内部評価方式が適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本	—	—	—	—	—	—	—	—	
15	外部格付準拠方式が適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本	—	—	—	—	—	—	—	—	
16	標準的手法準拠方式が適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本	—	—	—	—	—	—	—	—	
17	1250%のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本	—	—	—	—	—	—	—	—	

みずほ信託銀行連結の自己資本の充実の状況

(D) SEC4：信用リスク・アセットの額の算出対象となる証券化エクスポージャー及び関連する所要自己資本  
(投資家である場合)

(単位：百万円)

		2021年度								
		イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ	ト	チ	
項番	合計	資産譲渡型証券化取引(小計)		証券化		再証券化				
		証券化	裏付けとなる リート	裏付けとなる リート	ホールセール	再証券化				
						シニア	非シニア			
<b>エクスポージャーの額(リスク・ウェイト区分別)</b>										
1	20%以下のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	3,047	3,047	3,047	3,047	—	—	—	—	—
2	20%超50%以下のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	—	—	—	—	—	—	—	—	—
3	50%超100%以下のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	—	—	—	—	—	—	—	—	—
4	100%超125%未満のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	—	—	—	—	—	—	—	—	—
5	1250%のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	—	—	—	—	—	—	—	—	—
<b>エクスポージャーの額(算出方法別)</b>										
6	内部格付手法準拠方式又は内部評価方式が適用される証券化エクスポージャー	3,047	3,047	3,047	3,047	—	—	—	—	—
7	外部格付準拠方式が適用される証券化エクスポージャー	—	—	—	—	—	—	—	—	—
8	標準的手法準拠方式が適用される証券化エクスポージャー	—	—	—	—	—	—	—	—	—
9	1250%のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	—	—	—	—	—	—	—	—	—
<b>信用リスク・アセットの額(算出方法別)</b>										
10	内部格付手法準拠方式又は内部評価方式により算出した信用リスク・アセット	457	457	457	457	—	—	—	—	—
11	外部格付準拠方式により算出した信用リスク・アセット	—	—	—	—	—	—	—	—	—
12	標準的手法準拠方式により算出した信用リスク・アセット	—	—	—	—	—	—	—	—	—
13	1250%のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャーに係る信用リスク・アセット	—	—	—	—	—	—	—	—	—
<b>所要自己資本の額(算出方法別)</b>										
14	内部格付手法準拠方式又は内部評価方式が適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本	36	36	36	36	—	—	—	—	—
15	外部格付準拠方式が適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本	—	—	—	—	—	—	—	—	—
16	標準的手法準拠方式が適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本	—	—	—	—	—	—	—	—	—
17	1250%のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本	—	—	—	—	—	—	—	—	—

		2021年度								
		リ	ヌ	ル	ヲ	ワ	カ	ヨ		
項番	合計	合成型証券化取引(小計)		証券化		再証券化				
		証券化	裏付けとなる リート	裏付けとなる リート	ホールセール	再証券化				
						シニア	非シニア			
<b>エクスポージャーの額(リスク・ウェイト区分別)</b>										
1	20%以下のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	—	—	—	—	—	—	—	—	—
2	20%超50%以下のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	—	—	—	—	—	—	—	—	—
3	50%超100%以下のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	—	—	—	—	—	—	—	—	—
4	100%超125%未満のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	—	—	—	—	—	—	—	—	—
5	1250%のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	—	—	—	—	—	—	—	—	—
<b>エクスポージャーの額(算出方法別)</b>										
6	内部格付手法準拠方式又は内部評価方式が適用される証券化エクスポージャー	—	—	—	—	—	—	—	—	—
7	外部格付準拠方式が適用される証券化エクスポージャー	—	—	—	—	—	—	—	—	—
8	標準的手法準拠方式が適用される証券化エクスポージャー	—	—	—	—	—	—	—	—	—
9	1250%のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	—	—	—	—	—	—	—	—	—
<b>信用リスク・アセットの額(算出方法別)</b>										
10	内部格付手法準拠方式又は内部評価方式により算出した信用リスク・アセット	—	—	—	—	—	—	—	—	—
11	外部格付準拠方式により算出した信用リスク・アセット	—	—	—	—	—	—	—	—	—
12	標準的手法準拠方式により算出した信用リスク・アセット	—	—	—	—	—	—	—	—	—
13	1250%のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャーに係る信用リスク・アセット	—	—	—	—	—	—	—	—	—
<b>所要自己資本の額(算出方法別)</b>										
14	内部格付手法準拠方式又は内部評価方式が適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本	—	—	—	—	—	—	—	—	—
15	外部格付準拠方式が適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本	—	—	—	—	—	—	—	—	—
16	標準的手法準拠方式が適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本	—	—	—	—	—	—	—	—	—
17	1250%のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本	—	—	—	—	—	—	—	—	—

(単位：百万円)

項目		2022年度							
		イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ	ト	チ
		合計		証券化		再証券化			
		資産譲渡型 証券化取引 (小計)	証券化	裏付けとなる リート	ホールセール	再証券化	シニア	非シニア	
<b>エクスポージャーの額(リスク・ウェイト区分別)</b>									
1	20%以下のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	2,515	2,515	2,515	2,515	—	—	—	—
2	20%超50%以下のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	—	—	—	—	—	—	—	—
3	50%超100%以下のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	—	—	—	—	—	—	—	—
4	100%超1250%未満のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	—	—	—	—	—	—	—	—
5	1250%のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	—	—	—	—	—	—	—	—
<b>エクスポージャーの額(算出方法別)</b>									
6	内部格付手法準拠方式又は内部評価方式が適用される証券化エクスポージャー	2,515	2,515	2,515	2,515	—	—	—	—
7	外部格付準拠方式が適用される証券化エクスポージャー	—	—	—	—	—	—	—	—
8	標準的手法準拠方式が適用される証券化エクスポージャー	—	—	—	—	—	—	—	—
9	1250%のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	—	—	—	—	—	—	—	—
<b>信用リスク・アセットの額(算出方法別)</b>									
10	内部格付手法準拠方式又は内部評価方式により算出した信用リスク・アセット	377	377	377	377	—	—	—	—
11	外部格付準拠方式により算出した信用リスク・アセット	—	—	—	—	—	—	—	—
12	標準的手法準拠方式により算出した信用リスク・アセット	—	—	—	—	—	—	—	—
13	1250%のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャーに係る信用リスク・アセット	—	—	—	—	—	—	—	—
<b>所要自己資本の額(算出方法別)</b>									
14	内部格付手法準拠方式又は内部評価方式が適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本	30	30	30	30	—	—	—	—
15	外部格付準拠方式が適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本	—	—	—	—	—	—	—	—
16	標準的手法準拠方式が適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本	—	—	—	—	—	—	—	—
17	1250%のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本	—	—	—	—	—	—	—	—

項目		2022年度							
		リ	ヌ	ル	ヲ	ワ	カ	ヨ	
		合成型証券 化取引 (小計)		証券化		再証券化			
		証券化	裏付けとなる リート	ホールセール	再証券化	シニア	非シニア		
<b>エクスポージャーの額(リスク・ウェイト区分別)</b>									
1	20%以下のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	—	—	—	—	—	—	—	—
2	20%超50%以下のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	—	—	—	—	—	—	—	—
3	50%超100%以下のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	—	—	—	—	—	—	—	—
4	100%超1250%未満のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	—	—	—	—	—	—	—	—
5	1250%のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	—	—	—	—	—	—	—	—
<b>エクスポージャーの額(算出方法別)</b>									
6	内部格付手法準拠方式又は内部評価方式が適用される証券化エクスポージャー	—	—	—	—	—	—	—	—
7	外部格付準拠方式が適用される証券化エクスポージャー	—	—	—	—	—	—	—	—
8	標準的手法準拠方式が適用される証券化エクスポージャー	—	—	—	—	—	—	—	—
9	1250%のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	—	—	—	—	—	—	—	—
<b>信用リスク・アセットの額(算出方法別)</b>									
10	内部格付手法準拠方式又は内部評価方式により算出した信用リスク・アセット	—	—	—	—	—	—	—	—
11	外部格付準拠方式により算出した信用リスク・アセット	—	—	—	—	—	—	—	—
12	標準的手法準拠方式により算出した信用リスク・アセット	—	—	—	—	—	—	—	—
13	1250%のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャーに係る信用リスク・アセット	—	—	—	—	—	—	—	—
<b>所要自己資本の額(算出方法別)</b>									
14	内部格付手法準拠方式又は内部評価方式が適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本	—	—	—	—	—	—	—	—
15	外部格付準拠方式が適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本	—	—	—	—	—	—	—	—
16	標準的手法準拠方式が適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本	—	—	—	—	—	—	—	—
17	1250%のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本	—	—	—	—	—	—	—	—

みずほ信託銀行

● 連結の自己資本の充実の状況

みずほ信託銀行連結の自己資本の充実の状況

■マーケット・リスク

(1) トレーディング業務

(A) MR1：標準的方式によるマーケット・リスク相当額

(単位：百万円)

項番		2021年度	2022年度
		リスク・アセット (リスク相当額を8%で除して得た額)	リスク・アセット (リスク相当額を8%で除して得た額)
1	金利リスク(一般市場リスク及び個別リスク)の額	—	—
2	株式リスク(一般市場リスク及び個別リスク)の額	—	—
3	外国為替リスクの額	3,080	3,359
4	コモディティ・リスクの額	—	—
	オプション取引		
5	簡便法により算出した額	—	—
6	デルタ・プラス法により算出した額	—	—
7	シナリオ法により算出した額	—	—
8	証券化エクスポージャーに係る個別リスクの額	—	—
9	合計	3,080	3,359

(B) MR2：内部モデル方式を適用して算出されたリスク・アセットの額の変動要因

当行グループのトレーディング業務の縮小に伴う内部モデル方式の廃止に伴い、2021年10月以降VARによる管理は廃止しております。

(C) MR3：内部モデル方式の状況(マーケット・リスク)

当行グループのトレーディング業務の縮小に伴う内部モデル方式の廃止に伴い、2021年10月以降VARによる管理は廃止しております。

(D) MR4：内部モデル方式のバック・テストの結果

当行グループのトレーディング業務の縮小に伴う内部モデル方式の廃止に伴い、2021年10月以降VARによる管理は廃止しております。

## (2) バンキング業務

### (A) IRRBB1：金利リスク

(単位：百万円)

項番		イ		ロ		ハ		ニ	
		ΔEVE				ΔNII			
		2022年度		2021年度		2022年度		2021年度	
1	上方パラレルシフト	1,519	5,654	△23,291	△20,024				
2	下方パラレルシフト	2,130	0	23,433	19,129				
3	スティープ化	0	3,320	/	/				
4	フラット化	83	86	/	/				
5	短期金利上昇	245	546	/	/				
6	短期金利低下	391	153	/	/				
7	最大値	2,130	5,654	23,433	19,129				
		ホ				ヘ			
		2022年度		2021年度		2022年度		2021年度	
8	Tier1資本の額	444,748		442,428		444,748		442,428	

注) 1. 経済的価値・金利収益が減少する方向をプラスで表記しています。

2. 明確な金利改定間隔がなく、預金者の要求によって随時払い出される当座預金や普通預金等の一部では、コア預金として認識の上、適切な方法により計測を行っています。金利改定の平均満期は、円預金0.3年となります。最長の金利改定満期は、円預金4.5年となります。また、定期預金や貸出等は、返済・解約実績等を踏まえ期限前解約率を推定し、適切な方法により計測を行っています。

3. ΔEVEにおける複数の通貨の集計は、過去データに基づき主要通貨間の相関関係を推定する内部モデルを用いています。ΔNIIにおける複数の通貨の集計は、各通貨の単純合算により集計しています。

4. ΔEVE、ΔNIIの計測にあたり、割引金利や参照金利に応じて適切な金利やスプレッドを設定しています。

5. 算出にあたり、規制で定められた金利ショック等の前提を用いています。

## みずほ信託銀行連結の自己資本の充実の状況

## ■連結レバレッジ比率の構成に関する事項

## (1) レバレッジ比率の構成に関する事項

(単位：百万円、%)

国際様式(表2) の該当番号	国際様式(表1) の該当番号	項目	2021年度	2022年度
<b>1. オン・バランス資産の額</b>				
1		調整項目控除前のオン・バランス資産の額	4,164,165	4,032,589
1a	1	連結貸借対照表における総資産の額	4,207,876	4,090,926
1b	2	連結レバレッジ比率の範囲に含まれない子法人等の資産の額(△)	—	—
1c	7	連結レバレッジ比率の範囲に含まれる子会社の資産の額(連結貸借対照表における総資産の額に含まれる額を除く。)	—	—
1d	3	連結貸借対照表における総資産の額から控除される調整項目以外の資産の額(△)	43,711	58,336
2	7	Tier1資本に係る調整項目の額(△)	93,206	114,050
3		オン・バランス資産の額 (イ)	4,070,958	3,918,538
<b>2. デリバティブ取引等に関する額</b>				
4		デリバティブ取引等に関するRCの額に1.4を乗じた額	—	—
		デリバティブ取引等に関する再構築コストの額	7,747	13,670
5		デリバティブ取引等に関するPFEの額に1.4を乗じた額	—	—
		デリバティブ取引等に関するアドオンの額	7,741	14,854
		デリバティブ取引等に関連して現金で差し入れた証拠金の対価の額	919	3,084
6		連結貸借対照表から控除されているデリバティブ取引等に関連して差し入れた担保の対価の額	—	—
		連結貸借対照表から控除されているデリバティブ取引等に関連して現金で差し入れた証拠金の対価の額	—	—
7		デリバティブ取引等に関連して現金で差し入れた変動証拠金の対価の額のうち控除する額(△)	—	—
8		清算会員である銀行が補償を義務付けられていない顧客とのトレード・エクスポージャーの額(△)	/	/
9		クレジット・デリバティブのプロテクションを提供した場合における調整後想定元本の額	—	—
10		クレジット・デリバティブのプロテクションを提供した場合における調整後想定元本の額から控除した額(△)	—	—
11	4	デリバティブ取引等に関する額 (ロ)	16,408	31,610
<b>3. レボ取引等に関する額</b>				
12		レボ取引等に関する資産の額	20,046	20,177
13		レボ取引等に関する資産の額から控除した額(△)	—	—
14		レボ取引等に関するカウンターパーティ・リスクのエクスポージャーの額	14	39
15		代理取引のエクスポージャーの額	/	/
16	5	レボ取引等に関する額 (ハ)	20,060	20,217
<b>4. オフ・バランス取引に関する額</b>				
17		オフ・バランス取引の想定元本の額	499,729	483,816
18		オフ・バランス取引に係るエクスポージャーの額への交換調整の額(△)	270,235	262,781
19	6	オフ・バランス取引に関する額 (ニ)	229,493	221,035
<b>5. 連結レバレッジ比率</b>				
20		資本の額 (ホ)	442,428	444,748
21	8	総エクスポージャーの額((イ)+(ロ)+(ハ)+(ニ)) (ヘ)	4,336,920	4,191,401
22		連結レバレッジ比率((ホ)/(ヘ))	10.20%	10.61%
		適用する所要連結レバレッジ比率	/	3.00%
<b>6. 日本銀行に対する預け金を算入する場合の連結レバレッジ比率</b>				
		総エクスポージャーの額 (ヘ)	4,336,920	4,191,401
		日本銀行に対する預け金の額	1,908,419	2,689,097
		日本銀行に対する預け金を算入する場合の総エクスポージャーの額 (ヘ')	6,245,339	6,880,498
		日本銀行に対する預け金を算入する場合の連結レバレッジ比率((ホ)/(ヘ'))	7.08%	6.46%

注) 当行は、連結レバレッジ比率の算定に関する外部監査として、日本公認会計士協会専門業務実務指針4465「自己資本比率及びレバレッジ比率の算定に対する合意された手続業務に関する実務指針」に基づく合意された手続業務を、EY新日本有限責任監査法人により受けています。なお、当該業務は、連結財務諸表の監査又は財務報告に係る内部統制の監査の一部ではありません。

当該業務は、レバレッジ比率そのものやレバレッジ比率の算定に係る内部管理体制について意見又は結論を表明するものではなく、当行と合意した範囲において手続をEY新日本有限責任監査法人が実施し、当行に対しその結果を報告するものです。

みずほ信託銀行連結の流動性に係る経営の健全性の状況

「銀行法施行規則第19条の2第1項第5号ホ等の規定に基づき、経営の健全性の状況について金融庁長官が別に定める事項のうち、

流動性に係る健全性を判断するための基準に係る事項」(平成27年金融庁告示第7号)に基づき、開示しています。

■流動性カバレッジ比率

(1) 連結流動性カバレッジ比率に関する定量的開示事項

(単位：百万円、%、件)

項目	2022年度第3四半期		2022年度第4四半期	
適格流動資産 (1)	/		/	
1 適格流動資産の合計額	2,283,165		2,704,014	
資金流出額 (2)	資金流出率を乗じる前の額	資金流出率を乗じた後の額	資金流出率を乗じる前の額	資金流出率を乗じた後の額
2 リテール無担保資金調達に係る資金流出額	1,565,131	138,248	1,556,584	137,457
3 うち、安定預金の額	262,523	7,875	261,425	7,842
4 うち、準安定預金の額	1,302,607	130,372	1,295,159	129,615
5 ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,965,493	1,702,037	2,312,597	2,041,310
6 うち、適格オペレーショナル預金の額	-	-	-	-
7 うち、適格オペレーショナル預金及び負債性有価証券以外のホールセール無担保資金調達に係る資金の額	1,854,083	1,590,627	2,226,355	1,955,068
8 うち、負債性有価証券の額	111,409	111,409	86,242	86,242
9 有担保資金調達等に係る資金流出額	/	0	/	0
10 デリバティブ取引等、資金調達プログラム及び与信・流動性ファシリティに係る資金流出額	428,408	95,624	433,476	103,083
11 うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	20,027	20,027	19,386	19,386
12 うち、資金調達プログラムに係る資金流出額	0	0	0	0
13 うち、与信・流動性ファシリティに係る資金流出額	408,381	75,597	414,089	83,696
14 資金提供義務に基づく資金流出額等	6,120	5,939	5,851	5,830
15 偶発事象に係る資金流出額	992,558	1,550	991,686	1,549
16 資金流出合計額	/	1,943,401	/	2,289,232
資金流入額 (3)	資金流入率を乗じる前の額	資金流入率を乗じた後の額	資金流入率を乗じる前の額	資金流入率を乗じた後の額
17 有担保資金運用等に係る資金流入額	23,576	0	2,003	0
18 貸付金等の回収に係る資金流入額	208,767	148,457	260,604	174,701
19 その他資金流入額	7,899	2,116	9,506	2,010
20 資金流入合計額	240,242	150,573	272,114	176,711
連結流動性カバレッジ比率 (4)	/		/	
21 算入可能適格流動資産の合計額	/		/	
22 純資金流出額	/		/	
23 連結流動性カバレッジ比率	/		/	
24 平均値計算用データ数	62		60	

(2) 連結流動性カバレッジ比率に関する定性的開示事項

(A) 時系列における連結流動性カバレッジ比率の変動に関する事項

当行の連結LCRは、過去2年間安定的に推移しています。

(B) 連結流動性カバレッジ比率の水準の評価に関する事項

当行の連結LCRは、規制水準(100%)を上回っており、特段の問題はないものと評価しています。

なお、今後の連結LCRの見通しが開示された比率と大きく乖離することは想定していません。

また、連結LCRの実績値は当初の見通しと大きく異なっていません。

(C) 算入可能適格流動資産の合計額の内容に関する事項

算入可能適格流動資産の通貨又は種類等の構成や所在地に著しい変動はありません。

なお、主要な通貨(通貨建て負債合計額が当行の負債合計額の5%以上を占める通貨)において、算入可能適格流動資産の合計額と純資金流出額の間に、著しい通貨のミスマッチはありません。

(D) その他連結流動性カバレッジ比率に関する事項

当行の連結LCRは、告示第60号第29条の「適格オペレーショナル預金に係る特例」及び同告示第60号第38条の「シナリオ法による時価変動時所要追加担保額」を適用していません。

告示第60号第60条の「その他契約に基づく資金流出額」には、「小規模連結子法人に係る資金流出額」等を計上しています。

なお、告示第60号第53条の「その他偶発事象に係る資金流出額」、告示第60号第73条の「その他契約に基づく資金流入額」について開示が必要となる重要な項目はありません。

連結子会社に関するデータ等については、月次データもしくは四半期データを使用しています。

みずほ信託銀行連結の流動性に係る経営の健全性の状況

■安定調達比率

(1) 連結安定調達比率に関する定量的開示事項

(単位：百万円、%)

項番		2022年度第3四半期					2022年度第4四半期				
		算入率考慮前金額				算入率考慮後金額	算入率考慮前金額				算入率考慮後金額
		満期なし	6月未満	6月以上1年未満	1年以上		満期なし	6月未満	6月以上1年未満	1年以上	
<b>利用可能安定調達額 (1)</b>											
1	資本の額	569,255	0	0	0	569,255	563,622	0	0	0	563,622
2	うち、普通株式等Tier1資本、その他Tier1資本及びTier2資本(基準日から1年を経過する前に弁済期が到来するものを除く。)に係る基礎項目の額	569,255	0	0	0	569,255	563,622	0	0	0	563,622
3	うち、上記に含まれない資本調達手段及び資本の額	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
4	個人及び中小企業等からの資金調達	1,560,506	0	0	0	1,417,612	1,543,107	0	0	0	1,401,892
5	うち、安定預金等の額	263,149	0	0	0	249,992	261,933	0	0	0	248,836
6	うち、準安定預金等の額	1,297,356	0	0	0	1,167,620	1,281,173	0	0	0	1,153,056
7	ホールセール資金調達	1,091,235	2,240,209	383,860	558,166	1,490,842	1,051,112	2,632,961	382,513	514,447	1,552,218
8	うち、適格オペレーショナル預金の額	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
9	うち、その他のホールセール資金調達の額	1,091,235	2,240,209	383,860	558,166	1,490,842	1,051,112	2,632,961	382,513	514,447	1,552,218
10	相互に関係する資産がある負債	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
11	その他の負債	70,911	0	0	0	15,184	72,553	0	0	0	17,165
12	うち、デリバティブ負債の額	/	/	/	0	/	/	/	/	0	/
13	うち、上記に含まれない負債の額	70,911	0	0	0	15,184	72,553	0	0	0	17,165
14	利用可能安定調達額合計	/	/	/	/	3,492,895	/	/	/	/	3,534,899
<b>所要安定調達額 (2)</b>											
15	流動資産の額	/	/	/	/	57,136	/	/	/	/	59,710
16	金融機関等に預け入れているオペレーショナル預金に相当するものの額	4,562	0	0	0	2,281	4,422	0	0	0	2,211
17	貸出金又はレポ形式の取引による資産及び有価証券その他これに類するものの額	250,042	567,032	226,850	2,539,866	2,595,636	220,611	522,500	214,015	2,483,094	2,499,020
18	うち、レベル1資産を担保とする金融機関等への貸出金及びレポ形式の取引による額	0	40,216	0	0	0	0	20,177	0	0	0
19	うち、項番18に含まれない金融機関等への貸出金及びレポ形式の取引による額	223,593	110,637	68,701	334,493	419,321	192,968	145,321	44,823	322,743	395,899
20	うち、貸出金又はレポ形式の取引による資産の額(項番18、19及び22に該当する額を除く。)	299	385,083	154,821	2,091,733	2,044,266	299	325,921	167,954	2,071,786	1,992,276
21	うち、リスク・ウェイトが35%以下の資産の額	0	12,706	1,371	20,991	20,683	0	1,234	2,466	81,093	54,561
22	うち、住宅ローン債権	0	1,080	1,058	21,361	15,243	0	1,054	1,027	20,583	14,702
23	うち、リスク・ウェイトが35%以下の資産の額	0	992	971	19,915	13,927	0	970	946	19,173	13,420
24	うち、流動資産に該当しない有価証券その他これに類するもの	26,149	30,014	2,269	92,278	116,805	27,343	30,024	210	67,980	96,142
25	相互に関係する負債がある資産	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
26	その他の資産等	418,386	2,014	746	33,063	454,197	451,825	2,708	729	34,459	486,838
27	うち、現物決済されるコモディティ(金を含む。)	0	/	/	/	0	0	/	/	/	0
28	うち、デリバティブ取引等又は中央清算機関との取引に関連して預託した当初証拠金又は清算基金(連結貸借対照表に計上されないものを含む。)	/	/	/	0	0	/	/	/	16,500	14,025
29	うち、デリバティブ資産の額	/	/	/	26,590	26,590	/	/	/	255	255
30	うち、デリバティブ負債(変動証拠金の対価の額を減する前)の額	/	/	/	0	0	/	/	/	0	0
31	うち、上記に含まれない資産及び資本の額	418,386	2,014	746	6,473	427,606	451,825	2,708	729	17,704	472,557
32	オフ・バランス取引	/	/	/	1,408,086	21,972	/	/	/	1,405,672	21,243
33	所要安定調達額合計	/	/	/	/	3,131,223	/	/	/	/	3,069,023
34	連結安定調達比率	/	/	/	/	111.5%	/	/	/	/	115.1%

**(2) 連結安定調達比率に関する定性的開示事項****(A) 時系列における連結安定調達比率の変動に関する事項**

当行の連結NSFRは、2021年9月末の規制適用以降、安定的に推移しています。

**(B) 相互に関係する資産・負債の特例に関する事項**

当行の連結NSFRは、告示第60号第101条に定める「相互に関係する資産・負債の特例」を適用していません。

**(C) その他連結安定調達比率に関する事項**

当行の連結NSFRは、規制水準(100%)を上回っており、特段の問題はないものと評価しています。

なお、今後の連結NSFRの見通しが開示された比率と大きく乖離することは想定していません。

また、連結NSFRの実績値は当初の見通しと大きく異なっていません。

みずほ信託銀行連結の役職員の報酬等について

■役職員の報酬等について

(1) 報酬等に関する定量的開示事項

開示の対象となる金融庁告示に規定されている「対象役員」及び「対象従業員等」(あわせて「対象役職員」)の範囲については、以下の通りです。

①「対象役員」の範囲

「対象役員」は、当行の取締役です。なお、社外取締役を除いています。

②「対象従業員等」の範囲

当行では、当行の執行役員及び職員ならびに「主要な連結子法人等」の役職員のうち、「高額の報酬等を受ける者」、かつ「グループの業務の運営または財産の状況に重要な影響を与える者」等を「対象従業員等」として、開示の対象としています。

(ア)「主要な連結子法人等」の範囲

302ページ1.②(ア)に記載の定義と同様であり、当行における「主要な連結子法人等」はありません。

(イ)「高額の報酬等を受ける者」の範囲

「高額の報酬等を受ける者」とは、302ページ1.②(イ)に記載の基準額以上の報酬等を受ける者をさします。

(ウ)「グループの業務の運営または財産の状況に重要な影響を与える者」の範囲

「グループの業務の運営または財産の状況に重要な影響を与える者」とは、その者が通常行う取引や管理する事項が、当行、「主要な連結子法人等」の業務の運営に相当程度の影響を与え、または取引等に損失が発生することにより財産の状況に重要な影響を与える者をいいます。具体的には、当行の執行役員及び市場部門の従業員等を含みます。

(A) REM1：当該事業年度に割り当てられた報酬等

(単位：人、百万円)

項番		イ	ロ
		対象役員	対象従業員等
1	対象役員及び対象従業員等の数	5	—
2	固定報酬の総額 (3+5+7)	94	—
3	うち、現金報酬額	80	—
4	3のうち、繰延額	—	—
5	うち、株式報酬額又は株式連動型報酬額	14	—
6	5のうち、繰延額	14	—
7	うち、その他報酬額	—	—
8	7のうち、繰延額	—	—
9	対象役員及び対象従業員等の数	3	—
10	変動報酬の総額 (11+13+15)	61	—
11	うち、現金報酬額	32	—
12	11のうち、繰延額	0	—
13	うち、株式報酬額又は株式連動型報酬額	29	—
14	13のうち、繰延額	29	—
15	うち、その他報酬額	—	—
16	15のうち、繰延額	—	—
17	対象役員及び対象従業員等の数	—	—
18	退職慰労金の総額	—	—
19	うち、繰延額	—	—
20	対象役員及び対象従業員等の数	—	—
21	その他の報酬の総額	—	—
22	うち、繰延額	—	—
23	報酬等の総額 (2+10+18+21)	155	—

注) 1. 記載人数は、当事業年度に係る報酬等(2022年度分)及び当事業年度において支給または支給する見込みの額が明らかとなった2021年度に係る報酬等(2021年度分)を通じての実支給人数を記載しています。

2. 記載金額は、2022年度分及び2021年度分の合計金額を記載しています。

3. 「固定報酬の総額のうち、その他報酬額」は、2022年度に係る弔慰金保険料等を含みます。

4. 「変動報酬の総額のうち、現金報酬額」には、当行の取締役(非執行取締役を除く)及び執行役員に対して2021年度分として決定した業績給を含め記載しています。

なお、このうち一定額を超える部分については、2023年度より3年間に亘って繰延支給することを予定しています。

5. 「変動報酬の総額のうち、株式報酬額又は株式連動型報酬額」には、当行の取締役(社外取締役を除く)及び執行役員に対して2021年度分として付与した株式給付等ポイント(1ポイントが株式会社みずほフィナンシャルグループ株式1株に換算されます)に、株式会社みずほフィナンシャルグループ株式の帳簿価額(1,607,087円/株)を乗じた額を含め記載しています。なお、これらは、2023年度より3年間に亘って繰延支給することを予定しています。

6. 当行の取締役及び執行役員に対する当事業年度に係る業績給及び株式報酬Ⅱについては、現時点で金額が確定していないため、上記のいずれの報酬等にも含めていませんが、会計上は、所要の引当金を計上致しています。

## (B) REM2：特別報酬等

(単位：人、百万円)

	イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ
	ボーナス保証		採用時一時金		割増退職金	
	人数	総額	人数	総額	人数	総額
対象役員	-	-	-	-	-	-
対象従業員等	-	-	-	-	-	-

## (C) REM3：繰延報酬等

(単位：百万円)

	イ	ロ	ハ	ニ	ホ
	繰延報酬等の残高	イのうち、調整又は変動の対象となる繰延報酬等の残高	割当て後の報酬等に関して、当該事業年度に指標等の変動に連動しない調整を受けた変動額	割当て後の報酬等に関して、当該事業年度に指標等の変動に連動した調整を受けた変動額	当該事業年度に支払われた繰延報酬等の額
対象役員					
現金報酬額	0	0	-	-	-
株式報酬額又は株式連動型報酬額	45	45	-	9	9
その他の報酬額	-	-	-	-	-
対象従業員等					
現金報酬額	-	-	-	-	-
株式報酬額又は株式連動型報酬額	-	-	-	-	-
その他の報酬額	-	-	-	-	-
総額	45	45	-	9	9

## (D) 当グループの「対象役職員」の報酬等の体系に関し、その他参考となるべき事項

前項までに掲げたもののほか、特段該当する事項はありません。

## みずほ信託銀行単体の主要な指標

バーゼル銀行監督委員会の合意に基づく自己資本比率規制では、自己資本比率等の最低水準を充足することが求められています。

当行は、「銀行法第14条の2の規定に基づき、銀行がその保有する資産等に照らし自己資本の充実の状況が適当であるかどうかを判断するための基準」（平成18年金融庁告示第19号）に基づき、単体自己資本比率を算出しています。

また、当行は、「銀行法第14条の2の規定に基づき、銀行がその保有する資産等に照らし自己資本の充実の状況が適当であるかどうかを判断するための基準の補完的指標として定めるレバレッジに係る健全性を判断するための基準」（平成31年金融庁告示第11号）に基づき、単体レバレッジ比率を算出しています。

バーゼル銀行監督委員会の合意に基づく流動性比率規制では、流動性力バレッジ比率及び安定調達比率の最低水準を充足することが求められています。当行は、「銀行法第14条の2の規定に基づき、銀行がその経営の健全性を判断するための基準として定める流動性に係る健全性を判断するための基準」（平成26年金融庁告示第60号、以下「告示第60号」）に基づき、単体流動性力バレッジ比率（以下「単体LCR」）及び単体安定調達比率（以下「単体NSFR」）を算出しています。

### ■主要な指標

#### KM1：主要な指標

(単位：百万円、%)

国際様式の 該当番号		イ	ロ	ハ	ニ	ホ
		2022年度 第4四半期末	2022年度 第3四半期末	2022年度 第2四半期末	2022年度 第1四半期末	2021年度 第4四半期末
資本						
1	普通株式等Tier 1資本の額	425,277	446,792	436,362	430,712	425,738
2	Tier 1資本の額	425,277	446,792	436,362	430,712	425,738
3	総自己資本の額	425,443	446,845	436,411	430,758	425,800
リスク・アセット						
4	リスク・アセットの額	1,693,913	1,640,101	1,698,733	1,720,517	1,744,610
自己資本比率						
5	普通株式等Tier 1比率	25.10%	27.24%	25.68%	25.03%	24.40%
6	Tier 1比率	25.10%	27.24%	25.68%	25.03%	24.40%
7	総自己資本比率	25.11%	27.24%	25.69%	25.03%	24.40%
単体レバレッジ比率						
13	総エクスポージャーの額	4,073,301	4,182,750	4,166,243	4,278,301	4,216,857
14	単体レバレッジ比率	10.44%	10.68%	10.47%	10.06%	10.09%
単体流動性力バレッジ比率						
15	算入可能適格流動性資産の合計額	2,629,418	2,206,514	2,188,569	1,936,912	1,792,449
16	純資金流出額	2,020,301	1,650,241	1,534,025	1,326,184	1,194,260
17	単体流動性力バレッジ比率	130.3%	135.1%	144.1%	147.5%	152.5%
単体安定調達比率						
18	利用可能安定調達額	3,473,103	3,453,082	3,488,550	3,579,281	3,529,332
19	所要安定調達額	3,006,771	3,097,830	3,084,197	3,202,588	3,125,448
20	単体安定調達比率	115.5%	111.4%	113.1%	111.7%	112.9%

注) 項番15～17には四半期平均値を記載しています。

## みずほ信託銀行単体の自己資本の充実の状況

## ■自己資本

## (1) 自己資本の構成等

## (A) CC1：自己資本の構成

(単位：百万円、%)

国際様式の 該当番号	項目	イ 2021年度	ロ 2022年度	ハ 別紙様式第十三号 (CC2)の参照項目
<b>普通株式等Tier1資本に係る基礎項目</b>		<b>(1)</b>		
1a+2-1c-26	普通株式に係る株主資本の額	431,378	427,211	
1a	うち資本金及び資本剰余金の額	262,874	262,874	
2	うち利益剰余金の額	296,471	275,474	
1c	うち自己株式の額(△)	79,999	79,999	
26	うち社外流出予定額(△)	47,968	31,137	
	うち上記以外に該当するものの額	—	—	
1b	普通株式に係る新株予約権の額	—	—	
3	評価・換算差額等及びその他公表準備金の額	57,460	66,503	(a)
6	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	(イ) 488,839	493,715	
<b>普通株式等Tier1資本に係る調整項目</b>		<b>(2)</b>		
8+9	無形固定資産(モーゲージ・サービシング・ライセンスに係るものを除く。)の額の合計額	15,157	13,202	
8	うちのれんに係るものの額	271	227	
9	うちのれん及びモーゲージ・サービシング・ライセンスに係るもの以外のものの額	14,886	12,975	
10	繰延税金資産(一時差異に係るものを除く。)の額	—	—	
11	繰延ヘッジ損益の額	△246	4,642	
12	適格引当金不足額	1,976	1,292	
13	証券化取引に伴い増加した自己資本に相当する額	—	—	
14	負債の時価評価により生じた時価評価差額であって自己資本に算入される額	—	—	
15	前払年金費用の額	46,212	49,300	
16	自己保有普通株式(純資産の部に計上されるものを除く。)の額	—	—	
17	意図的に保有している他の金融機関等の普通株式の額	—	—	
18	少数出資金融機関等の普通株式の額	—	—	
19+20+21	特定項目に係る10%基準超過額	—	—	
19	うちその他金融機関等に係る対象資本等調達手段のうち普通株式に該当するものに関連するものの額	—	—	
20	うち無形固定資産(モーゲージ・サービシング・ライセンスに係るものに限る。)に関連するものの額	—	—	
21	うち繰延税金資産(一時差異に係るものに限る。)に関連するものの額	—	—	
22	特定項目に係る15%基準超過額	—	—	
23	うちその他金融機関等に係る対象資本等調達手段のうち普通株式に該当するものに関連するものの額	—	—	
24	うち無形固定資産(モーゲージ・サービシング・ライセンスに係るものに限る。)に関連するものの額	—	—	
25	うち繰延税金資産(一時差異に係るものに限る。)に関連するものの額	—	—	
27	その他Tier1資本不足額	—	—	
28	普通株式等Tier1資本に係る調整項目の額	(ロ) 63,100	68,437	
<b>普通株式等Tier1資本</b>				
29	普通株式等Tier1資本の額((イ)-(ロ))	(ハ) 425,738	425,277	

(次ページへ続く)

## みずほ信託銀行単体の自己資本の充実の状況

(続き)

(単位：百万円、%)

国際様式の 該当番号	項目		イ 2021年度	ロ 2022年度	ハ 別紙様式第十三号 (CC2)の参照項目
<b>その他Tier1資本に係る基礎項目</b>		(3)			
30 31a	その他Tier1資本調達手段に係る株主資本の額及びその内訳		—	—	
30 31b	その他Tier1資本調達手段に係る新株予約権の額		—	—	
30 32	その他Tier1資本調達手段に係る負債の額		—	—	
30	特別目的会社等の発行するその他Tier1資本調達手段の額		—	—	
33+35	適格旧Tier1資本調達手段の額のうちその他Tier1資本に係る基礎項目の額に含まれる額		/	/	
36	その他Tier1資本に係る基礎項目の額	(二)	—	—	
<b>その他Tier1資本に係る調整項目</b>					
37	自己保有その他Tier1資本調達手段の額		—	—	
38	意図的に保有している他の金融機関等のその他Tier1資本調達手段の額		—	—	
39	少数出資金融機関等のその他Tier1資本調達手段の額		—	—	
40	その他金融機関等のその他Tier1資本調達手段の額		—	—	
42	Tier2資本不足額		—	—	
43	その他Tier1資本に係る調整項目の額	(ホ)	—	—	
<b>その他Tier1資本</b>					
44	その他Tier1資本の額((二)-(ホ))	(ヘ)	—	—	
<b>Tier1資本</b>					
45	Tier1資本の額((ハ)+(ヘ))	(ト)	425,738	425,277	
<b>Tier2資本に係る基礎項目</b>		(4)			
46	Tier2資本調達手段に係る株主資本の額及びその内訳		—	—	
46	Tier2資本調達手段に係る新株予約権の額		—	—	
46	Tier2資本調達手段に係る負債の額		—	—	
46	特別目的会社等の発行するTier2資本調達手段の額		—	—	
47+49	適格旧Tier2資本調達手段の額のうちTier2資本に係る基礎項目の額に含まれる額		/	/	
50	一般貸倒引当金Tier2算入額及び適格引当金Tier2算入額の合計額		61	166	
50a	うち一般貸倒引当金Tier2算入額		61	166	
50b	うち適格引当金Tier2算入額		—	—	
51	Tier2資本に係る基礎項目の額	(チ)	61	166	

(次ページへ続く)

(続き)

(単位：百万円、%)

国際様式の 該当番号	項目		イ 2021年度	ロ 2022年度	ハ 別紙様式第十三号 (CC2)の参照項目
<b>Tier2資本に係る調整項目</b>		(5)			
52	自己保有Tier2資本調達手段の額		—	—	
53	意図的に保有している他の金融機関等のTier2資本調達手段及びその他外部TLAC関連調達手段の額		—	—	
54	少数出資金融機関等のTier2資本調達手段及びその他外部TLAC関連調達手段の額		—	—	
55	その他金融機関等のTier2資本調達手段及びその他外部TLAC関連調達手段の額		—	—	
57	Tier2資本に係る調整項目の額	(リ)	—	—	
<b>Tier2資本</b>					
58	Tier2資本の額((チ)-(リ))	(ヌ)	61	166	
<b>総自己資本</b>					
59	総自己資本の額((ト)+(ヌ))	(ル)	425,800	425,443	
<b>リスク・アセット</b>		(6)			
60	リスク・アセットの額	(ヲ)	1,744,610	1,693,913	
<b>自己資本比率</b>		(7)			
61	普通株式等Tier1比率((ハ)/(ヲ))		24.40%	25.10%	
62	Tier1比率((ト)/(ヲ))		24.40%	25.10%	
63	総自己資本比率((ル)/(ヲ))		24.40%	25.11%	
<b>調整項目に係る参考事項</b>		(8)			
72	少数出資金融機関等の対象資本等調達手段に係る調整項目不算入額		7,640	8,028	
73	その他金融機関等に係る対象資本等調達手段のうち普通株式に係る調整項目不算入額		556	812	
74	無形固定資産(モーゲージ・サービシング・ライセンスに係るものに限る。)に係る調整項目不算入額		—	—	
75	繰延税金資産(一時差異に係るものに限る。)に係る調整項目不算入額		9,480	4,956	
<b>Tier2資本に係る基礎項目の額に算入される引当金に関する事項</b>		(9)			
76	一般貸倒引当金の額		61	166	
77	一般貸倒引当金に係るTier2資本算入上限額		530	864	
78	内部格付手法採用行において、適格引当金の合計額から事業法人等向けエクスポージャー及びリテール向けエクスポージャーの期待損失額の合計額を控除した額(当該額が零を下回る場合にあっては、零とする。)		—	—	
79	適格引当金に係るTier2資本算入上限額		8,650	8,112	
<b>資本調達手段に係る経過措置に関する事項</b>		(10)			
82	適格旧Tier1資本調達手段に係る算入上限額		/	/	
83	適格旧Tier1資本調達手段の額から適格旧Tier1資本調達手段に係る算入上限額を控除した額(当該額が零を下回る場合にあっては、零とする。)		/	/	
84	適格旧Tier2資本調達手段に係る算入上限額		/	/	
85	適格旧Tier2資本調達手段の額から適格旧Tier2資本調達手段に係る算入上限額を控除した額(当該額が零を下回る場合にあっては、零とする。)		/	/	

注) 1. 上記は「銀行法第14条の2の規定に基づき、銀行がその保有する資産等に照らし自己資本の充実の状況が適当であるかどうかを判断するための基準」(平成18年金融庁告示第19号。以下、「告示」という。)に基づいて算出したものであり、国際統一基準を採用した単体ベースの計数となっています。

2. 当行は、単体自己資本比率の算定に関する外部監査として、日本公認会計士協会専門業務実務指針4.4.6.5「自己資本比率及びレバレッジ比率の算定に対する合意された手続業務に関する実務指針」に基づく合意された手続業務を、EY新日本有限責任監査法人により受けています。なお、当該業務は、財務諸表の監査又は財務報告に係る内部統制の監査の一部ではありません。当該業務は自己資本比率そのものや自己資本比率の算定に係る内部管理体制について意見又は結論を表明するものではなく、当行と合意した範囲において手続をEY新日本有限責任監査法人が実施し、当行に対しその結果を報告するものです。

## みずほ信託銀行単体の自己資本の充実の状況

## (B) CC2：貸借対照表の科目と自己資本の構成に関する開示項目の対応関係

(単位：百万円)

項目			ハ	ニ
	イ	ロ	別紙様式第一号を参照する番号又は記号	付表を参照する番号又は記号
	公表 貸借対照表 2021年度	公表 貸借対照表 2022年度		
<b>(資産の部)</b>				
現金預け金	1,923,672	2,704,297		
債券貸借取引支払保証金	20,046	20,177		
買入金銭債権	35,314	32,261		
金銭の信託	26,556	27,418		
有価証券	288,530	265,136		6-b
貸出金	3,192,348	3,065,766		6-c
外国為替	3,898	5,160		
その他資産	255,755	277,573		6-d
有形固定資産	100,132	93,577		
無形固定資産	21,728	18,929		2
前払年金費用	66,607	71,058		3
支払承諾見返	14,100	13,655		
貸倒引当金	△2,470	△3,601		
<b>資産の部合計</b>	<b>5,946,221</b>	<b>6,591,410</b>		
<b>(負債の部)</b>				
預金	2,571,352	2,780,028		
譲渡性預金	691,880	470,180		
コールマネー	603,990	907,935		
借入金	300,000	303,400		7-a
信託勘定借	1,167,284	1,534,097		
その他負債	31,317	28,363		6-f
賞与引当金	2,741	3,134		
変動報酬引当金	272	245		
退職給付引当金	4,935	2,273		
睡眠預金払戻損失引当金	992	714		
移転損失引当金	3,061	—		
繰延税金負債	17,484	22,527		4-b
支払承諾	14,100	13,655		
<b>負債の部合計</b>	<b>5,409,413</b>	<b>6,066,558</b>		
<b>(純資産の部)</b>				
資本金	247,369	247,369		1-a
資本剰余金	15,505	15,505		1-b
利益剰余金	296,471	275,474		1-c
自己株式	△79,999	△79,999		1-d
<b>株主資本合計</b>	<b>479,346</b>	<b>458,349</b>		
その他有価証券評価差額金	57,707	61,861		
繰延ヘッジ損益	△246	4,642		
<b>評価・換算差額等合計</b>	<b>57,460</b>	<b>66,503</b>	(a)	5
<b>純資産の部合計</b>	<b>536,807</b>	<b>524,852</b>		
<b>負債及び純資産の部合計</b>	<b>5,946,221</b>	<b>6,591,410</b>		

注) 規制上の連結の範囲と会計上の連結の範囲は同一であります。

〈付表〉

1. 株主資本

①貸借対照表

(単位：百万円)

参照番号	貸借対照表科目	2021年度	2022年度	備考
1-a	資本金	247,369	247,369	
1-b	資本剰余金	15,505	15,505	
1-c	利益剰余金	296,471	275,474	
1-d	自己株式	△79,999	△79,999	
	<b>株主資本合計</b>	<b>479,346</b>	<b>458,349</b>	

②自己資本の構成

(単位：百万円)

国際様式の 該当番号	自己資本の構成に関する開示事項	2021年度	2022年度	備考
	普通株式等Tier1資本に係る額	479,346	458,349	普通株式に係る株主資本(社外流出予定額調整前)
1a	うち資本金及び資本剰余金の額	262,874	262,874	
2	うち利益剰余金の額	296,471	275,474	
1c	うち自己株式の額(△)	79,999	79,999	
	うち上記以外に該当するものの額	—	—	
31a	その他Tier1資本調達手段に係る額	—	—	

2. 無形固定資産

①貸借対照表

(単位：百万円)

参照番号	貸借対照表科目	2021年度	2022年度	備考
2	無形固定資産	21,728	18,929	
	上記に係る税効果	△6,570	△5,726	

②自己資本の構成

(単位：百万円)

国際様式の 該当番号	自己資本の構成に関する開示事項	2021年度	2022年度	備考
8	無形固定資産 のれんに係るもの	271	227	
9	無形固定資産 その他の無形固定資産	14,886	12,975	のれん、モーゲージ・サービシング・ライセンス以外(ソフトウェア等)
	無形固定資産 モーゲージ・サービシング・ライセンス	—	—	
20	特定項目に係る10%基準超過額	—	—	
24	特定項目に係る15%基準超過額	—	—	
74	無形固定資産(モーゲージ・サービシング・ライセンスに係るものに限る。)に係る調整項目不算入額	—	—	

みずほ信託銀行単体の自己資本の充実の状況

3. 前払年金費用

①貸借対照表

(単位：百万円)

参照番号	貸借対照表科目	2021年度	2022年度	備考
3	前払年金費用	66,607	71,058	
	上記に係る税効果	△20,395	△21,758	

②自己資本の構成

(単位：百万円)

国際様式の 該当番号	自己資本の構成に関する開示事項	2021年度	2022年度	備考
15	前払年金費用の額	46,212	49,300	

4. 繰延税金資産

①貸借対照表

(単位：百万円)

参照番号	貸借対照表科目	2021年度	2022年度	備考
	繰延税金資産	—	—	
4-b	繰延税金負債	17,484	22,527	
	無形固定資産の税効果勘案分	6,570	5,726	
	前払年金費用の税効果勘案分	20,395	21,758	

②自己資本の構成

(単位：百万円)

国際様式の 該当番号	自己資本の構成に関する開示事項	2021年度	2022年度	備考
10	繰延税金資産(一時差異に係るものを除く。)	—	—	
	一時差異に係る繰延税金資産	9,480	4,956	
21	特定項目に係る10%基準超過額	—	—	
25	特定項目に係る15%基準超過額	—	—	
75	繰延税金資産(一時差異に係るものに限る。)に係る調整項目不算入額	9,480	4,956	

5. 繰延ヘッジ損益

①貸借対照表

(単位：百万円)

参照番号	貸借対照表科目	2021年度	2022年度	備考
5	繰延ヘッジ損益	△246	4,642	

②自己資本の構成

(単位：百万円)

国際様式の 該当番号	自己資本の構成に関する開示事項	2021年度	2022年度	備考
11	繰延ヘッジ損益の額	△246	4,642	ヘッジ対象に係る時価評価差額が「評価・換算差額等合計」として計上されているものを除いたもの

## 6. 金融機関向け出資等の対象科目

### ①貸借対照表

(単位：百万円)

参照番号	貸借対照表科目	2021年度	2022年度	備考
	特定取引資産	—	—	
6-b	有価証券	288,530	265,136	
6-c	貸出金	3,192,348	3,065,766	
6-d	その他資産	255,755	277,573	金融派生商品、出資金等を含む
	特定取引負債	—	—	
6-f	その他負債	31,317	28,363	金融派生商品等を含む

### ②自己資本の構成

(単位：百万円)

国際様式の 該当番号	自己資本の構成に関する開示事項	2021年度	2022年度	備考
	自己保有資本調達手段の額	—	—	
16	普通株式等Tier1相当額	—	—	
37	その他Tier1相当額	—	—	
52	Tier2相当額	—	—	
	意図的に保有している他の金融機関等の資本 調達手段の額	—	—	
17	普通株式等Tier1相当額	—	—	
38	その他Tier1相当額	—	—	
53	Tier2相当額及びその他外部TLAC関連調達 手段の額	—	—	
	少数出資金融機関等の資本調達手段の額	7,640	8,028	
18	普通株式等Tier1相当額	—	—	
39	その他Tier1相当額	—	—	
54	Tier2相当額及びその他外部TLAC関連調達 手段の額	—	—	
72	少数出資金融機関等の対象資本等調達手段 に係る調整項目不算入額	7,640	8,028	
	その他金融機関等(10%超出資)	556	812	
19	特定項目に係る10%基準超過額	—	—	
23	特定項目に係る15%基準超過額	—	—	
40	その他Tier1相当額	—	—	
55	Tier2相当額及びその他外部TLAC関連調達 手段の額	—	—	
73	その他金融機関等に係る対象資本等調達手 段のうち普通株式に係る調整項目不算入額	556	812	

## 7. その他資本調達

### ①貸借対照表

(単位：百万円)

参照番号	貸借対照表科目	2021年度	2022年度	備考
7-a	借入金	300,000	303,400	
	社債	—	—	
	合計	300,000	303,400	

### ②自己資本の構成

(単位：百万円)

国際様式の 該当番号	自己資本の構成に関する開示事項	2021年度	2022年度	備考
32	その他Tier1資本調達手段に係る負債の額	—	—	
46	Tier2資本調達手段に係る負債の額	—	—	

みずほ信託銀行単体の自己資本の充実の状況

■ リスク・アセットの概要

(A) OV1：リスク・アセットの概要

(単位：百万円)

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	
		2022年度	2021年度	2022年度	2021年度
1	信用リスク	1,150,060	1,231,470	96,717	103,705
2	うち、標準的手法適用分	—	—	—	—
3	うち、内部格付手法適用分	981,869	1,080,788	83,262	91,650
	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	168,190	150,682	13,455	12,054
4	カウンターパーティ信用リスク	3,558	3,392	297	286
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	0	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	899	309	71	24
	その他	2,657	3,082	225	261
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	144,759	116,343	12,275	9,865
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）	39,141	33,918	3,268	2,827
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	13	0	1
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	602	717	48	57
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	602	717	48	57
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	47	56	3	4
17	うち、標準的方式適用分	47	56	3	4
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	271,713	260,088	21,737	20,807
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	271,713	260,088	21,737	20,807
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	14,423	25,093	1,163	2,014
	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(スケーリング・ファクター勘案後)	1,693,913	1,744,610	135,513	139,568

## ■マーケット・リスク

### (1) バンキング業務

#### (A) IRRBB1:金利リスク

(単位：百万円)

項番		イ		ロ		ハ		ニ	
		ΔEVE				ΔNII			
		2022年度		2021年度		2022年度		2021年度	
1	上方パラレルシフト	1,519	5,654	△23,291	△20,024				
2	下方パラレルシフト	2,130	0	23,433	19,129				
3	スティープ化	0	3,320	/	/				
4	フラット化	83	86	/	/				
5	短期金利上昇	245	546	/	/				
6	短期金利低下	391	153	/	/				
7	最大値	2,130	5,654	23,433	19,129				
		ホ				へ			
		2022年度				2021年度			
8	Tier1資本の額	425,277				425,738			

- 注) 1. 経済的価値・金利収益が減少する方向をプラスで表記しています。  
 2. 明確な金利改定間隔がなく、預金者の要求によって随時払い出される当座預金や普通預金等の一部では、コア預金として認識の上、適切な方法により計測を行っています。金利改定の平均満期は、円預金0.3年となります。最長の金利改定満期は、円預金4.5年となります。また、定期預金や貸出等は、返済・解約実績等を踏まえ期限前解約率を推定し、適切な方法により計測を行っています。  
 3. ΔEVEにおける複数の通貨の集計は、過去データに基づき主要通貨間の相関関係を推定する内部モデルを用いています。ΔNIIにおける複数の通貨の集計は、各通貨の単純合算により集計しています。  
 4. ΔEVE、ΔNIIの計測にあたり、割引金利や参照金利に応じて適切な金利やスプレッドを設定しています。  
 5. 算出にあたり、規制で定められた金利ショック等の前提を用いています。

## みずほ信託銀行単体の自己資本の充実の状況

## ■単体レバレッジ比率の構成に関する事項

## (1) レバレッジ比率の構成に関する事項

(単位：百万円、%)

国際様式(表2) の該当番号	国際様式(表1) の該当番号	項目	2021年度	2022年度
<b>1. オン・バランス資産の額</b>				
1		調整項目控除前のオン・バランス資産の額	3,994,099	3,843,976
1a	1	貸借対照表における総資産の額	4,037,801	3,902,313
1b	3	貸借対照表における総資産の額から控除される調整項目以外の資産の額(△)	43,701	58,336
2	7	Tier1 資本に係る調整項目の額(△)	63,347	63,795
3		オン・バランス資産の額 (イ)	3,930,752	3,780,180
<b>2. デリバティブ取引等に関する額</b>				
4		デリバティブ取引等に関するRCの額に1.4を乗じた額	—	—
		デリバティブ取引等に関する再構築コストの額	7,747	13,670
5		デリバティブ取引等に関するPFEの額に1.4を乗じた額	—	—
		デリバティブ取引等に関するアドオンの額	7,741	14,854
		デリバティブ取引等に関連して現金で差し入れた証拠金の対価の額	919	3,084
6		貸借対照表から控除されているデリバティブ取引等に関連して差し入れた担保の対価の額	—	—
		貸借対照表から控除されているデリバティブ取引等に関連して現金で差し入れた証拠金の対価の額	—	—
7		デリバティブ取引等に関連して現金で差し入れた変動証拠金の対価の額のうち控除する額(△)	—	—
8		清算会員である銀行が補償を義務付けられていない顧客とのトレード・エクスポージャーの額(△)	/	/
9		クレジット・デリバティブのプロテクションを提供した場合における調整後想定元本の額	—	—
10		クレジット・デリバティブのプロテクションを提供した場合における調整後想定元本の額から控除した額(△)	—	—
11	4	デリバティブ取引等に関する額 (ロ)	16,408	31,610
<b>3. レボ取引等に関する額</b>				
12		レボ取引等に関する資産の額	20,046	20,177
13		レボ取引等に関する資産の額から控除した額(△)	—	—
14		レボ取引等に関するカウンターパーティ・リスクのエクスポージャーの額	20,046	20,177
15		代理取引のエクスポージャーの額	/	/
16	5	レボ取引等に関する額 (ハ)	40,092	40,355
<b>4. オフ・バランス取引に関する額</b>				
17		オフ・バランス取引の想定元本の額	500,919	485,016
18		オフ・バランス取引に係るエクスポージャーの額への変換調整の額(△)	271,315	263,861
19	6	オフ・バランス取引に関する額 (ニ)	229,604	221,155
<b>5. 単体レバレッジ比率</b>				
20		資本の額 (ホ)	425,738	425,277
21	8	総エクスポージャーの額((イ)+(ロ)+(ハ)+(ニ)) (ヘ)	4,216,857	4,073,301
22		単体レバレッジ比率((ホ)/(ヘ))	10.09%	10.44%
		適用する所要単体レバレッジ比率	/	3.00%
<b>6. 日本銀行に対する預け金を算入する場合の単体レバレッジ比率</b>				
		総エクスポージャーの額 (ヘ)	4,216,857	4,073,301
		日本銀行に対する預け金の額	1,908,419	2,689,097
		日本銀行に対する預け金を算入する場合の総エクスポージャーの額 (ヘ')	6,125,277	6,762,398
		日本銀行に対する預け金を算入する場合の単体レバレッジ比率((ホ)/(ヘ'))	6.95%	6.28%

注) 当行は、単体レバレッジ比率の算定に関する外部監査として、日本公認会計士協会専門業務実務指針4465「自己資本比率及びレバレッジ比率の算定に対する合意された手続業務に関する実務指針」に基づく合意された手続業務を、EY新日本有限責任監査法人により受けています。なお、当該業務は、財務諸表の監査又は財務報告に係る内部統制の監査の一部ではありません。当該業務は、レバレッジ比率そのものやレバレッジ比率の算定に係る内部管理体制について意見又は結論を表明するものではなく、当行と合意した範囲において手続をEY新日本有限責任監査法人が実施し、当行に対しその結果を報告するものです。

みずほ信託銀行単体の流動性に係る経営の健全性の状況

「銀行法施行規則第19条の2第1項第5号ホ等の規定に基づき、経営の健全性の状況について金融庁長官が別に定める事項のうち、

流動性に係る健全性を判断するための基準に係る事項」(平成27年金融庁告示第7号)に基づき、開示しています。

■流動性カバレッジ比率

(1) 単体流動性カバレッジ比率に関する定量的開示事項

(単位：百万円、%、件)

項目	2022年度第3四半期		2022年度第4四半期	
適格流動資産 (1)	/		/	
1 適格流動資産の合計額	2,206,514		2,629,418	
資金流出額 (2)	資金流出率を乗じる前の額	資金流出率を乗じた後の額	資金流出率を乗じる前の額	資金流出率を乗じた後の額
2 リテール無担保資金調達に係る資金流出額	1,565,131	138,248	1,556,584	137,457
3 うち、安定預金の額	262,523	7,875	261,425	7,842
4 うち、準安定預金の額	1,302,607	130,372	1,295,159	129,615
5 ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,818,417	1,554,961	2,199,607	1,928,320
6 うち、適格オペレーショナル預金の額	-	-	-	-
7 うち、適格オペレーショナル預金及び負債性有価証券以外のホールセール無担保資金調達に係る資金の額	1,707,008	1,443,552	2,113,364	1,842,078
8 うち、負債性有価証券の額	111,409	111,409	86,242	86,242
9 有担保資金調達等に係る資金流出額	/	0	/	0
10 デリバティブ取引等、資金調達プログラム及び与信・流動性ファシリティに係る資金流出額	428,407	95,624	437,509	104,696
11 うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	20,026	20,026	19,386	19,386
12 うち、資金調達プログラムに係る資金流出額	0	0	0	0
13 うち、与信・流動性ファシリティに係る資金流出額	408,381	75,597	418,123	85,310
14 資金提供義務に基づく資金流出額等	1,305	1,124	1,849	1,828
15 偶発事象に係る資金流出額	993,759	1,586	992,887	1,585
16 資金流出合計額	/	1,791,545	/	2,173,889
資金流入額 (3)	資金流入率を乗じる前の額	資金流入率を乗じた後の額	資金流入率を乗じる前の額	資金流入率を乗じた後の額
17 有担保資金運用等に係る資金流入額	23,576	0	2,003	0
18 貸付金等の回収に係る資金流入額	195,077	134,768	235,969	150,066
19 その他資金流入額	7,286	6,536	3,578	3,521
20 資金流入合計額	225,940	141,304	241,551	153,587
単体流動性カバレッジ比率 (4)	/		/	
21 算入可能適格流動資産の合計額	/		2,206,514	/
22 純資金流出額	/		1,650,241	/
23 単体流動性カバレッジ比率	/		135.1%	/
24 平均値計算用データ数	62		60	

(2) 単体流動性カバレッジ比率に関する定性的開示事項

(A) 時系列における単体流動性カバレッジ比率の変動に関する事項

当行の単体LCRは、過去2年間安定的に推移しています。

(B) 単体流動性カバレッジ比率の水準の評価に関する事項

当行の単体LCRは、規制水準(100%)を上回っており、特段の問題はないものと評価しています。

なお、今後の単体LCRの見通しが開示された比率と大きく乖離することは想定していません。

また、単体LCRの実績値は当初の見通しと大きく異なっておりません。

(C) 算入可能適格流動資産の合計額の内容に関する事項

算入可能適格流動資産の通貨又は種類等の構成や所在地に著しい変動はありません。

なお、主要な通貨(通貨建て負債合計額が当行の負債合計額の5%以上を占める通貨)において、算入可能適格流動資産の合計額と純資金流出額の間に、著しい通貨のミスマッチはありません。

(D) その他単体流動性カバレッジ比率に関する事項

当行の単体LCRは、告示第60号第29条の「適格オペレーショナル預金に係る特例」及び同告示第60号第38条の「シナリオ法による時価変動時所要追加担保額」を適用していません。

なお、告示第60号第60条の「その他契約に基づく資金流出額」、告示第60号第53条の「その他偶発事象に係る資金流出額」、告示第60号第73条の「その他契約に基づく資金流入額」について開示が必要となる重要な項目はありません。

単体LCRに与える影響に鑑み、重要性が乏しい項目等については、日次データを使用していない場合があります。

みずほ信託銀行単体の流動性に係る経営の健全性の状況

■安定調達比率

(1) 単体安定調達比率に関する定量的開示事項

(単位：百万円、%)

項番		2022年度第3四半期					2022年度第4四半期				
		算入率考慮前金額				算入率考慮後金額	算入率考慮前金額				算入率考慮後金額
		満期なし	6月未満	6月以上1年未満	1年以上		満期なし	6月未満	6月以上1年未満	1年以上	
<b>利用可能安定調達額 (1)</b>											
1	資本の額	522,998	0	0	0	522,998	493,881	0	0	0	493,881
2	うち、普通株式等Tier1資本、その他Tier1資本及びTier2資本(基準日から1年を経過する前に弁済期が到来するものを除く。)に係る基礎項目の額	522,998	0	0	0	522,998	493,881	0	0	0	493,881
3	うち、上記に含まれない資本調達手段及び資本の額	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
4	個人及び中小企業等からの資金調達	1,560,506	0	0	0	1,417,612	1,543,107	0	0	0	1,401,892
5	うち、安定預金等の額	263,149	0	0	0	249,992	261,933	0	0	0	248,836
6	うち、準安定預金等の額	1,297,356	0	0	0	1,167,620	1,281,173	0	0	0	1,153,056
7	ホールセール資金調達	946,352	2,240,209	383,860	558,166	1,497,287	957,628	2,630,700	382,513	514,447	1,560,163
8	うち、適格オペレーショナル預金の額	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
9	うち、その他のホールセール資金調達の額	946,352	2,240,209	383,860	558,166	1,497,287	957,628	2,630,700	382,513	514,447	1,560,163
10	相互に関係する資産がある負債	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
11	その他の負債	50,347	0	0	0	15,184	49,489	0	0	0	17,165
12	うち、デリバティブ負債の額	/	/	/	0	/	/	/	/	0	/
13	うち、上記に含まれない負債の額	50,347	0	0	0	15,184	49,489	0	0	0	17,165
14	利用可能安定調達額合計	/	/	/	/	3,453,082	/	/	/	/	3,473,103
<b>所要安定調達額 (2)</b>											
15	流動資産の額	/	/	/	/	57,136	/	/	/	/	59,710
16	金融機関等に預け入れているオペレーショナル預金に相当するものの額	5,208	0	0	0	2,604	5,160	0	0	0	2,580
17	貸出金又はレポ形式の取引による資産及び有価証券その他これに類するものの額	135,529	549,881	226,850	2,550,866	2,586,543	168,381	487,298	214,015	2,494,094	2,496,904
18	うち、レベル1資産を担保とする金融機関等への貸出金及びレポ形式の取引による額	0	40,216	0	0	0	0	20,177	0	0	0
19	うち、項番18に含まれない金融機関等への貸出金及びレポ形式の取引による額	109,082	93,487	68,701	345,493	410,229	140,740	110,119	44,823	333,743	393,784
20	うち、貸出金又はレポ形式の取引による資産の額(項番18、19及び22に該当する額を除く。)	299	385,083	154,821	2,091,733	2,044,266	299	325,921	167,954	2,071,786	1,992,276
21	うち、リスク・ウェイトが35%以下の資産の額	0	12,706	1,371	20,991	20,683	0	1,234	2,466	81,093	54,561
22	うち、住宅ローン債権	0	1,080	1,058	21,361	15,243	0	1,054	1,027	20,583	14,702
23	うち、リスク・ウェイトが35%以下の資産の額	0	992	971	19,915	13,927	0	970	946	19,173	13,420
24	うち、流動資産に該当しない有価証券その他これに類するもの	26,147	30,014	2,269	92,278	116,804	27,341	30,024	210	67,980	96,140
25	相互に関係する負債がある資産	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
26	その他の資産等	393,727	2,014	746	33,063	429,538	391,283	2,708	729	34,459	426,296
27	うち、現物決済されるコモディティ(金を含む。)	0	/	/	/	0	0	/	/	/	0
28	うち、デリバティブ取引等又は中央清算機関との取引に関連して預託した当初証拠金又は清算基金(連結貸借対照表に計上されないものを含む。)	/	/	/	0	0	/	/	/	16,500	14,025
29	うち、デリバティブ資産の額	/	/	/	26,590	26,590	/	/	/	255	255
30	うち、デリバティブ負債(変動証拠金の対価の額を減する前)の額	/	/	/	0	0	/	/	/	0	0
31	うち、上記に含まれない資産及び資本の額	393,727	2,014	746	6,473	402,948	391,283	2,708	729	17,704	412,016
32	オフ・バランス取引	/	/	/	1,409,289	22,008	/	/	/	1,406,872	21,279
33	所要安定調達額合計	/	/	/	/	3,097,830	/	/	/	/	3,006,771
34	単体安定調達比率	/	/	/	/	111.4%	/	/	/	/	115.5%

## (2) 単体安定調達比率に関する定性的開示事項

### (A) 時系列における単体安定調達比率の変動に関する事項

当行の単体NSFRは、2021年9月末の規制適用以降、安定的に推移しています。

### (B) 相互に関係する資産・負債の特例に関する事項

当行の単体NSFRは、告示第60号第101条に定める「相互に関係する資産・負債の特例」を適用していません。

### (C) その他単体安定調達比率に関する事項

当行の単体NSFRは、規制水準(100%)を上回っており、特段の問題はないものと評価しています。

なお、今後の単体NSFRの見通しが開示された比率と大きく乖離することは想定していません。

また、単体NSFRの実績値は当初の見通しと大きく異なっていません。

みずほ信託銀行単体の役職員の報酬等について

■役職員の報酬等について

(1) 報酬等に関する定量的開示事項

開示の対象となる金融庁告示に規定されている「対象役員」及び「対象従業員等」(あわせて「対象役職員」)の範囲については、以下の通りです。

①「対象役員」の範囲

「対象役員」は、当行の取締役です。なお、社外取締役を除いています。

②「対象従業員等」の範囲

当行では、当行の執行役員及び職員のうち、「高額の報酬等を受ける者」、かつ「当行の業務の運営または財産の状況に重要な影響を与える者」等を「対象従業員等」として、開示の対象としています。

(ア)「高額の報酬等を受ける者」の範囲

「高額の報酬等を受ける者」とは、302ページ1.②(イ)に記載の基準額以上の報酬等を受ける者をさします。

(イ)「当行の業務の運営または財産の状況に重要な影響を与える者」の範囲

「当行の業務の運営または財産の状況に重要な影響を与える者」とは、その者が通常行う取引や管理する事項が、当行の業務の運営に相当程度の影響を与え、または取引等に損失が発生することにより財産の状況に重要な影響を与える者をいいます。具体的には、当行の執行役員及び市場部門の従業員等を含みます。

(A) REM1：当該事業年度に割り当てられた報酬等

(単位：人、百万円)

項番		イ	
		対象役員	対象従業員等
1	対象役員及び対象従業員等の数	5	—
2	固定報酬の総額 (3+5+7)	94	—
3	うち、現金報酬額	80	—
4	3のうち、繰延額	—	—
5	うち、株式報酬額又は株式連動型報酬額	14	—
6	5のうち、繰延額	14	—
7	うち、その他報酬額	—	—
8	7のうち、繰延額	—	—
9	対象役員及び対象従業員等の数	3	—
10	変動報酬の総額 (11+13+15)	61	—
11	うち、現金報酬額	32	—
12	11のうち、繰延額	0	—
13	うち、株式報酬額又は株式連動型報酬額	29	—
14	13のうち、繰延額	29	—
15	うち、その他報酬額	—	—
16	15のうち、繰延額	—	—
17	対象役員及び対象従業員等の数	—	—
18	退職慰労金の総額	—	—
19	うち、繰延額	—	—
20	対象役員及び対象従業員等の数	—	—
21	その他の報酬の総額	—	—
22	うち、繰延額	—	—
23	報酬等の総額 (2+10+18+21)	155	—

注) 1. 記載人数は、当事業年度に係る報酬等(2022年度分)及び当事業年度において支給し又は支給する見込みの額が明らかとなった2021年度に係る報酬等(2021年度分)を通じての実支給人数を記載しています。  
 2. 記載金額は、2022年度分及び2021年度分の合計金額を記載しています。  
 3. 「固定報酬の総額のうち、その他報酬額」は、2022年度に係る弔慰金保険料等を含みます。  
 4. 「変動報酬の総額のうち、現金報酬額」には、当行の取締役(非執行取締役を除く)及び執行役員に対して2021年度分として決定した業績給を含め記載しています。なお、このうち一定額を超える部分については、2023年度より3年間に亘って繰延支給することを予定しています。  
 5. 「変動報酬の総額のうち、株式報酬額又は株式連動型報酬額」には、当行の取締役(社外取締役を除く)及び執行役員に対して2021年度分として付与した株式給付等ポイント(1ポイントが株式会社みずほフィナンシャルグループ株式1株に換算されます)に、株式会社みずほフィナンシャルグループ株式の帳簿価額(1,607.087円/株)を乗じた額を含め記載しています。なお、これらは、2023年度より3年間に亘って繰延支給することを予定しています。  
 6. 当行の取締役及び執行役員に対する当事業年度に係る業績給及び株式報酬Ⅱについては、現時点で金額が確定していないため、上記のいずれの報酬等にも含めていませんが、会計上は、所要の引当金を計上致しています。

## (B) REM2：特別報酬等

(単位：人、百万円)

	イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ
	ボーナス保証		採用時一時金		割増退職金	
	人数	総額	人数	総額	人数	総額
対象役員	-	-	-	-	-	-
対象従業員等	-	-	-	-	-	-

## (C) REM3：繰延報酬等

(単位：百万円)

	イ	ロ	ハ	ニ	ホ
	繰延報酬等の残高	イのうち、調整又は変動の対象となる繰延報酬等の残高	割当て後の報酬等に関して、当該事業年度に指標等の変動に連動しない調整を受けた変動額	割当て後の報酬等に関して、当該事業年度に指標等の変動に連動した調整を受けた変動額	当該事業年度に支払われた繰延報酬等の額
対象役員					
現金報酬額	0	0	-	-	-
株式報酬額又は株式連動型報酬額	45	45	-	9	9
その他の報酬額	-	-	-	-	-
対象従業員等					
現金報酬額	-	-	-	-	-
株式報酬額又は株式連動型報酬額	-	-	-	-	-
その他の報酬額	-	-	-	-	-
総額	45	45	-	9	9

## (D) 当グループの「対象役職員」の報酬等の体系に関し、その他参考となるべき事項

前項までに掲げたもののほか、特段該当する事項はありません。