

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
		2023年度 第4四半期末	2023年度 第3四半期末	2023年度 第2四半期末	2023年度 第1四半期末	2022年度 第4四半期末
資本						
1	普通株式等Tier1資本の額	476,609	483,526	471,507	460,215	444,732
2	Tier1資本の額	476,624	483,542	471,524	460,230	444,748
3	総自己資本の額	476,729	483,662	471,676	460,373	444,929
リスク・アセット						
4	リスク・アセットの額	1,644,448	1,638,890	1,659,176	1,662,894	1,714,312
4a	リスク・アセットの額(フロア調整前)	1,644,448	/	/	/	/
	リスク・アセットの額(フロア調整最終実施ベース)	2,039,354	/	/	/	/
自己資本比率						
5	連結普通株式等Tier1比率	28.98%	29.50%	28.41%	27.67%	25.94%
5a	連結普通株式等Tier1比率(フロア調整前)	28.98%	/	/	/	/
	連結普通株式等Tier1比率(フロア調整最終実施ベース)	23.37%	/	/	/	/
6	連結Tier1比率	28.98%	29.50%	28.41%	27.67%	25.94%
6a	連結Tier1比率(フロア調整前)	28.98%	/	/	/	/
	連結Tier1比率(フロア調整最終実施ベース)	23.37%	/	/	/	/
7	連結総自己資本比率	28.99%	29.51%	28.42%	27.68%	25.95%
7a	連結総自己資本比率(フロア調整前)	28.99%	/	/	/	/
	連結総自己資本比率(フロア調整最終実施ベース)	23.37%	/	/	/	/
連結レバレッジ比率						
13	総エクスポージャーの額	4,100,351	4,143,089	4,070,999	4,432,823	4,191,401
14	連結レバレッジ比率	11.62%	11.67%	11.58%	10.38%	10.61%
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	2,517,145	2,519,163	2,668,457	2,915,526	2,704,014
16	純資金流出額	1,734,750	1,904,192	1,882,992	1,858,481	2,112,520
17	連結流動性カバレッジ比率	148.3%	132.7%	142.5%	157.6%	128.1%
連結安定調達比率						
18	利用可能安定調達額	3,423,833	3,438,467	3,508,947	3,661,306	3,534,899
19	所要安定調達額	2,943,018	2,931,331	2,987,921	3,156,617	3,069,023
20	連結安定調達比率	116.3%	117.3%	117.4%	115.9%	115.1%

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

2022年度、2023年度とも、該当ありません。

(B) 連結子会社の数

	2022年度	2023年度
連結子会社	12社	11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、67～74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

2022年度、2023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

2022年度、2023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

2022年度、2023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

2022年度、2023年度とも、該当ありません。

みずほ信託銀行連結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 2022年度	ロ 2023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	465,604	
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	299,933	307,440	
1c	うち自己株式の額(△)	79,999	79,999	
26	うち社外流出予定額(△)	31,137	27,030	
	うち上記以外に該当するものの額	—	—	
1b	普通株式に係る株式引受権及び新株予約権の合計額	—	—	
3	その他の包括利益累計額及びその他公表準備金の額	109,433	145,087	(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) 563,424	610,692	
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	25,272	25,238	
8	うちのれんに係るもの(のれん相当差額を含む。)の額	10,727	9,860	
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	14,544	15,378	
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	4,642	6,624	
12	適格引当金不足額	1,293	4,126	
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	87,485	98,093	
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) 118,692	134,083	
普通株式等Tier1資本				
29	普通株式等Tier1資本の額((イ)-(ロ))	(ハ) 444,732	476,609	

(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 2022年度	ロ 2023年度	ハ 別紙様式第十四号 (CC2)の参照項目
その他Tier1資本に係る基礎項目		(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株式引受権及び新株予約権の合計額		—	—	
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	その他Tier1資本に係る調整後非支配株主持分等の額		15	15	
36	その他Tier1資本に係る基礎項目の額	(二)	15	15	
その他Tier1資本に係る調整項目					
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)	—	—	
その他Tier1資本					
44	その他Tier1資本の額((二)－(ホ))	(ハ)	15	15	
Tier1資本					
45	Tier1資本の額((ハ)＋(ハ))	(ト)	444,748	476,624	
Tier2資本に係る基礎項目		(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株式引受権及び新株予約権の合計額		—	—	
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	Tier2資本に係る調整後非支配株主持分等の額		3	3	
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		177	101	
50a	うち一般貸倒引当金Tier2算入額		177	101	
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)	181	105	

(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 2022年度	ロ 2023年度	ハ 別紙様式第十四号 (CC2)の参照項目
Tier2資本に係る調整項目		(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)	—	—	
Tier2資本					
58	Tier2資本の額((チ)-(リ))	(ヌ)	181	105	
総自己資本					
59	総自己資本の額((ト)+(ヌ))	(ル)	444,929	476,729	
リスク・アセット		(6)			
60	リスク・アセットの額	(ヲ)	1,714,312	1,644,448	
連結自己資本比率		(7)			
61	連結普通株式等Tier1比率((ハ)/(ヲ))		25.94%	28.98%	
62	連結Tier1比率((ト)/(ヲ))		25.94%	28.98%	
63	連結総自己資本比率((ル)/(ヲ))		25.95%	28.99%	
調整項目に係る参考事項		(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		8,028	11,622	
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		2,104	3,989	
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		5,459	1,142	
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		(9)			
76	一般貸倒引当金の額		177	101	
77	一般貸倒引当金に係るTier2資本算入上限額		1,289	985	
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		7,695	7,407	

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。

(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 2022年度	公表 連結貸借対照表 2023年度		
(資産の部)				
現金預け金	2,820,307	1,293,384		
債券貸借取引支払保証金	20,177	20,066		
買入金銭債権	32,261	23,296		
金銭の信託	27,418	30,298		
有価証券	260,751	299,872		2-b, 6-b
貸出金	3,054,766	2,857,263		6-c
外国為替	4,422	5,271		
その他資産	290,010	358,864		6-d
有形固定資産	101,802	95,526		
無形固定資産	31,152	31,465		2-a
退職給付に係る資産	126,096	141,385		3
繰延税金資産	863	981		4-a
支払承諾見返	13,655	14,142		
貸倒引当金	△3,662	△5,279		
資産の部合計	6,780,023	5,166,539		
(負債の部)				
預金	2,875,774	2,741,330		
譲渡性預金	470,180	264,030		
コールマネー及び売渡手形	907,935	8,046		
借入金	303,400	409,200		8-a
信託勘定借	1,534,097	983,877		
その他負債	33,184	43,568		6-f
賞与引当金	5,046	7,455		
変動報酬引当金	245	271		
退職給付に係る負債	1,097	1,159		
役員退職慰労引当金	141	188		
偶発損失引当金	—	50		
睡眠預金払戻損失引当金	714	506		
繰延税金負債	39,895	54,864		4-b
支払承諾	13,655	14,142		
負債の部合計	6,185,368	4,528,692		
(純資産の部)				
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	299,933	307,440		1-c
自己株式	△79,999	△79,999		1-d
株主資本合計	485,128	492,635		
その他有価証券評価差額金	61,505	89,814		
繰延ヘッジ損益	4,642	6,624		5
為替換算調整勘定	3,523	4,507		
退職給付に係る調整累計額	39,762	44,140		
その他の包括利益累計額合計	109,433	145,087	(a)	
非支配株主持分	93	123		7
純資産の部合計	594,655	637,847		
負債及び純資産の部合計	6,780,023	5,166,539		

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。

みずほ信託銀行連結の自己資本の充実の状況

〈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	2022年度	2023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	299,933	307,440	
1-d	自己株式	△79,999	△79,999	
	株主資本合計	485,128	492,635	

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	2022年度	2023年度	備考
	普通株式等Tier1資本に係る額	485,128	492,635	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	299,933	307,440	
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	2022年度	2023年度	備考
2-a	無形固定資産	31,152	31,465	
2-b	有価証券	260,751	299,872	
	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	△5,880	△6,227	

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	2022年度	2023年度	備考
8	無形固定資産 のれんに係るもの	10,727	9,860	
9	無形固定資産 その他の無形固定資産	14,544	15,378	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り)に係る調整項目不算入額	—	—	

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	2022年度	2023年度	備考
3	退職給付に係る資産	126,096	141,385	
	上記に係る税効果	△38,610	△43,292	

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	2022年度	2023年度	備考
15	退職給付に係る資産の額	87,485	98,093	

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	2022年度	2023年度	備考
4-a	繰延税金資産	863	981	
4-b	繰延税金負債	39,895	54,864	
	無形固定資産の税効果勘案分	5,880	6,227	
	退職給付に係る資産の税効果勘案分	38,610	43,292	

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	2022年度	2023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	5,459	1,142	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	5,459	1,142	

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	2022年度	2023年度	備考
5	繰延ヘッジ損益	4,642	6,624	

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	2022年度	2023年度	備考
11	繰延ヘッジ損益の額	4,642	6,624	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

みずほ信託銀行連結の自己資本の充実の状況

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	2022年度	2023年度	備考
	特定取引資産	—	—	
6-b	有価証券	260,751	299,872	
6-c	貸出金	3,054,766	2,857,263	
6-d	その他資産	290,010	358,864	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	33,184	43,568	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	2022年度	2023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	—	—	
	少数出資金金融機関等の資本調達手段の額	8,028	11,622	
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	8,028	11,622	
	その他金融機関等(10%超出資)	2,104	3,989	
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	2,104	3,989	

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	2022年度	2023年度	備考
7	非支配株主持分	93	123	

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	2022年度	2023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	15	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

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	2022年度	2023年度	備考
8-a	借入金	303,400	409,200	
	社債	—	—	
	合計	303,400	409,200	

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	2022年度	2023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	—	—	

みずほ信託銀行連結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
		リスク・アセット 2022年度	所要自己資本 2022年度
1	信用リスク	1,092,211	91,663
2	うち、標準的手法適用分	22,095	1,767
3	うち、内部格付手法適用分	893,043	75,730
	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	14,165
4	カウンターパーティ信用リスク	910	72
5	うち、SA-CCR適用分	—	—
	うち、カレント・エクスポージャー方式適用分	1	0
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	—	—
	うち、CVAリスク	—	—
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	899	71
	その他	9	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	13,859
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	3,268
9	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算(マンデート方式)	—	—
	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算(蓋然性方式250%)	—	—
	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算(蓋然性方式400%)	3,011	255
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	226
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	48
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	602	48
14	うち、外部格付準拠方式適用分	—	—
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	—	—
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	—	—
16	マーケット・リスク	3,359	268
17	うち、標準的方式適用分	3,359	268
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	25,944
20	うち、基礎的手法適用分	52,587	4,207
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	21,737
23	特定項目のうち、調整項目に算入されない部分に係るエクスポージャー	18,911	1,538
	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	137,145

(単位：百万円)

国際様式の 概要番号		イ		ロ	
		リスク・アセット		所要自己資本	
		2023年度		2023年度	
1	信用リスク	1,174,531	93,962		
2	うち、標準的手法適用分	189,747	15,179		
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	491,524	39,321		
4	うち、スロットティング・クライテリア適用分	—	—		
5	うち、先進的内部格付手法適用分	346,026	27,682		
	うち、重要な出資のエクスポージャー	—	—		
	うち、リース取引における見積残存価額のエクスポージャー	—	—		
	その他	147,233	11,778		
6	カウンターパーティ信用リスク	1,266	101		
7	うち、SA-CCR適用分	—	—		
8	うち、期待エクスポージャー方式適用分	—	—		
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	571	45		
9	その他	695	55		
10	CVAリスク	—	—		
	うち、SA-CVA適用分	—	—		
	うち、完全なBA-CVA適用分	—	—		
	うち、限定的なBA-CVA適用分	—	—		
11	経過措置により適用されるマーケット・ベース方式に基づく株式等エクスポージャー	181,579	14,526		
12	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算（ルック・スルー方式）	34,816	2,785		
13	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算（マンドート方式）	—	—		
	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算（蓋然性方式250%）	2,453	196		
	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算（蓋然性方式400%）	—	—		
14	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算（フォールバック方式1250%）	771	61		
15	未決済取引	—	—		
16	信用リスク・アセットの額の算出対象となっている証券化エクスポージャー	3,308	264		
17	うち、内部格付手法準拠方式適用分	3,308	264		
18	うち、外部格付準拠方式又は内部評価方式適用分	—	—		
19	うち、標準的手法準拠方式適用分	—	—		
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	—	—		
20	マーケット・リスク	22,040	1,763		
21	うち、標準的方式適用分	—	—		
22	うち、内部モデル方式適用分	—	—		
	うち、簡易的方式適用分	22,040	1,763		
23	勘定間の振替分	—	—		
24	オペレーショナル・リスク	210,849	16,867		
25	特定項目のうち、調整項目に算入されない部分に係るエクスポージャー	12,829	1,026		
26	フロア調整	—	—		
27	合計	1,644,448	131,555		

注) 株式等エクスポージャーにおいて、内部格付手法で計測される場合に適用されるリスク・ウェイトと、標準的手法で計測される場合に適用されるリスク・ウェイトが同値の場合については、標準的手法を適用しているものとみなします。

みずほ信託銀行連結の自己資本の充実の状況

■内部モデルを用いた手法と標準的手法の比較

(A) CMS1：内部モデルを用いた手法と標準的手法のリスク・アセットの比較

(単位：百万円)

項番		2023年度			
		イ	ロ	ハ	ニ
		リスク・アセットの額			
		内部モデルを用いて算出したリスク・アセットの額	標準的な手法適用分のリスク・アセットの額	リスク・アセットの額	資本フロア計算に用いられる、標準的な手法により算出したリスク・アセットの額(フロア掛目前)
1	信用リスク	837,551	189,747	1,027,298	2,083,506
2	カウンターパーティ信用リスク	572	693	1,266	1,267
3	CVAリスク		—	—	—
4	信用リスク・アセットの額の算出対象となっている証券化エクスポージャー	3,308	—	3,308	1,636
5	マーケット・リスク	—	22,040	22,040	22,040
6	オペレーショナル・リスク	—	210,849	210,849	210,849
7	その他リスク・アセット	—	379,684	379,684	232,350
8	合計	841,432	803,016	1,644,448	2,551,651

注) 株式等エクスポージャーにおいて、内部格付手法で計測される場合に適用されるリスク・ウェイトと、標準的手法で計測される場合に適用されるリスク・ウェイトが同値の場合については、標準的手法を適用しているものとみなします。

(B) CMS2：ポートフォリオ別の内部格付手法と標準的手法の信用リスク・アセットの比較

(単位：百万円)

項番		2023年度			
		イ	ロ	ハ	ニ
		信用リスク・アセットの額			
		内部格付手法適用分の信用リスク・アセットの額	イ欄の内部格付手法適用分の信用リスク・アセットの額について、標準的手法により算出した信用リスク・アセットの額	信用リスク・アセットの額	資本フロア計算に用いられる、標準的手法により算出した信用リスク・アセットの額(フロア掛目前)
1	ソブリン向けエクスポージャー	1,288	1,472	1,288	1,472
	うち、我が国の地方公共団体向け	—	—	—	—
	うち、外国の中央政府等以外の公共部門向け	—	—	—	—
	うち、国際開発銀行向け	—	—	—	—
	うち、地方公共団体金融機構向け	80	150	80	150
	うち、我が国の政府関係機関向け	1,168	1,303	1,168	1,303
	うち、地方三公社向け	40	19	40	19
2	金融機関等向けエクスポージャー	58,562	60,856	83,103	85,397
3	株式等向けエクスポージャー	35,821	20,656	200,001	184,835
4	購入債権	2,241	6,647	2,241	6,647
5	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。)	526,383	1,120,725	527,409	1,121,751
	うち、基礎的内部格付手法適用分	430,721	—	430,721	—
	うち、先進的内部格付手法適用分	95,662	—	95,662	—
6	中堅中小企業向けエクスポージャー	51,317	121,490	51,317	121,490
	うち、基礎的内部格付手法適用分	—	—	—	—
	うち、先進的内部格付手法適用分	51,317	—	51,317	—
7	居住用不動産向けエクスポージャー	16,525	13,973	16,525	13,973
8	適格リボルビング型リテール向けエクスポージャー	—	—	—	—
9	その他リテール向けエクスポージャー	26,942	84,092	26,942	84,092
10	特定貸付債権	118,469	463,845	118,469	463,845
	うち、事業用不動産向け貸付け及びボラティリティの高い事業用不動産向け貸付け	115,174	458,654	115,174	458,654
11	合計	837,551	1,893,759	1,027,298	2,083,506

注) 株式等エクスポージャーにおいて、内部格付手法で計測される場合に適用されるリスク・ウェイトと、標準的手法で計測される場合に適用されるリスク・ウェイトが同値の場合については、標準的手法を適用しているものとみなします。

■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)

	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				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		
資産							
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
資産合計	6,780,023		6,522,120	141,181	4,015	—	112,705
負債							
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
負債合計	6,185,368		—	7,748	—	—	6,177,619

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

(単位：百万円)

	2023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	証券化エクスポーチャー (ヘ欄に該当する額を除く。)	マーケット・リスク		
資産							
現金預け金	1,293,384		1,293,384	—	—	—	—
債券貸借取引支払保証金	20,066		—	20,066	—	—	—
買入金銭債権	23,296		21,333	—	1,963	—	—
金銭の信託	30,298		30,298	—	—	—	—
有価証券	299,872		299,872	—	—	—	—
貸出金	2,857,263		2,855,763	—	1,500	—	—
外国為替	5,271		5,271	—	—	—	—
金融派生商品	26,209		—	26,209	—	—	—
その他資産	332,654		251,496	81,158	—	—	—
有形固定資産	95,526		95,526	—	—	—	—
無形固定資産	31,465		6,227	—	—	—	25,238
退職給付に係る資産	141,385		43,292	—	—	—	98,093
繰延税金資産	981		981	—	—	—	—
支払承諾見返	14,142		14,142	—	—	—	—
貸倒引当金	△5,279		△5,278	—	—	—	△1
資産合計	5,166,539		4,912,310	127,435	3,463	—	123,330
負債							
預金	2,741,330		—	—	—	—	2,741,330
譲渡性預金	264,030		—	—	—	—	264,030
コールマネー及び売渡手形	8,046		—	—	—	—	8,046
借入金	409,200		—	—	—	—	409,200
信託勘定借	983,877		—	—	—	—	983,877
金融派生商品	10,151		—	10,151	—	—	—
その他負債	33,416		—	—	—	—	33,416
賞与引当金	7,455		—	—	—	—	7,455
変動報酬引当金	271		—	—	—	—	271
退職給付に係る負債	1,159		—	—	—	—	1,159
役員退職慰労引当金	188		—	—	—	—	188
偶発損失引当金	50		50	—	—	—	—
睡眠預金払戻損失引当金	506		—	—	—	—	506
繰延税金負債	54,864		—	—	—	—	54,864
支払承諾	14,142		—	—	—	—	14,142
負債合計	4,528,692		50	10,151	—	—	4,518,490

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。

(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		2022年度				
		イ	ロ	ハ	ニ	ホ
		合計	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	レポ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、イ欄はロ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。
- ・レポ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		2023年度				
		イ	ロ	ハ	ニ	ホ
		合計	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	5,043,208	4,912,310	127,435	3,463	—
2	自己資本比率規制上の連結範囲に基づく負債の額	10,201	50	10,151	—	—
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	5,033,007	4,912,260	117,283	3,463	—
4	オフ・バランスシートの額	175,832	172,332	—	3,500	—
5	引当て及び償却を勘案することによる差異	5,501	5,501	—	—	—
6	デリバティブ取引等による差異	△68,636	—	△68,636	—	—
7	レポ形式の取引による差異	24,876	—	24,876	—	—
8	その他の差異	△3,550	△3,550	—	—	—
9	自己資本比率規制上のエクスポージャーの額	5,167,031	5,086,544	73,523	6,963	—

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、イ欄はロ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。
- ・レポ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。

みずほ信託銀行連結の自己資本の充実の状況

■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	2022年度				
	イ	ロ	ハ	ニ	
	帳簿価額 デフォルトした エクスポージャー	額の総額 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)	
オン・バランスシートの資産					
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	オン・バランスシートの資産の合計(1+2+3)	21,010	6,007,678	3,512	6,025,176
オフ・バランスシートの資産					
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	オフ・バランスシートの資産の合計(5+6)	85	405,288	9	405,364
合計					
8	合計(4+7)	21,095	6,412,966	3,521	6,430,540

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	2023年度				
	イ	ロ	ハ	ニ	
	帳簿価額 デフォルトした エクスポージャー	額の総額 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)	
オン・バランスシートの資産					
1	貸出金	25,422	2,831,637	5,021	2,852,038
2	有価証券(うち負債性のもの)	—	91,565	—	91,565
3	その他オン・バランスシートの資産(うち負債性のもの)	—	1,317,883	70	1,317,813
4	オン・バランスシートの資産の合計(1+2+3)	25,422	4,241,086	5,091	4,261,416
オフ・バランスシートの資産					
5	支払承諾等	—	14,142	17	14,125
6	コミットメント等	130	361,293	—	361,423
7	オフ・バランスシートの資産の合計(5+6)	130	375,435	17	375,548
合計					
8	合計(4+7)	25,552	4,616,521	5,109	4,636,965

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。

(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)

	2022年度				2023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	34,963	2,648	30,220	67,832	32,252	2,982	14,696	49,931
海外	65	2	5	72	74	3	9	87
アジア	57	2	0	59	59	2	0	61
中南米	—	—	—	—	14	—	—	14
北米	—	—	0	0	—	—	6	6
東欧	—	—	—	—	—	—	—	—
西欧	—	0	4	5	—	0	2	2
その他の地域	7	—	0	7	—	1	0	1
合計	35,028	2,650	30,225	67,905	32,326	2,986	14,705	50,018
標準的手法適用分	/	/	/	2,278	/	/	/	2,245

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又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)

	2022年度				2023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	5,809	828	39	6,676	5,216	1,037	47	6,301
建設業	518	77	—	596	549	86	—	635
不動産業	14,870	1,074	0	15,946	13,109	1,053	1	14,163
各種サービス業	785	35	0	821	365	30	1	396
卸売・小売業	1,597	196	111	1,905	1,524	211	—	1,735
金融・保険業	3,332	74	1,979	5,386	2,978	91	2,163	5,232
個人	516	—	—	516	1,649	—	0	1,649
その他の業種	7,597	363	1,203	9,164	6,933	476	1,160	8,571
日本国・日本銀行	0	—	26,890	26,891	—	—	11,331	11,331
合計	35,028	2,650	30,225	67,905	32,326	2,986	14,705	50,018
標準的手法適用分	/	/	/	2,278	/	/	/	2,245

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又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)

	2022年度				2023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	6,342	1	28,448	34,792	6,014	—	13,525	19,539
1年以上3年未満	8,223	203	—	8,427	8,531	82	0	8,615
3年以上5年未満	8,902	191	0	9,094	7,362	222	0	7,585
5年以上	11,461	290	146	11,898	10,364	312	120	10,798
期間の定めのないもの等	98	1,963	1,630	3,692	53	2,368	1,058	3,480
合計	35,028	2,650	30,225	67,905	32,326	2,986	14,705	50,018
標準的手法適用分	/	/	/	2,278	/	/	/	2,245

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又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。

みずほ信託銀行連結の自己資本の充実の状況

(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)

	2022年度			2023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	153	20	0	201	39	0
海外	57	1	—	57	1	—
アジア	57	1	—	57	1	—
中南米	—	—	—	—	—	—
北米	—	—	—	—	—	—
東欧	—	—	—	—	—	—
西欧	—	—	—	—	—	—
その他の地域	—	—	—	—	—	—
合計	211	22	0	258	40	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又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)

	2022年度			2023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	116	15	—	235	36	—
建設業	—	—	—	0	—	—
不動産業	1	—	—	1	—	—
各種サービス業	7	2	—	6	2	0
卸売・小売業	10	2	—	3	0	—
金融・保険業	—	—	—	0	—	—
個人	15	0	0	12	0	—
その他の業種	59	1	—	0	1	—
合計	211	22	0	258	40	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又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)

2022年度					合計
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		
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。

(単位：億円)

2023年度					合計
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		
4	2	3	—		10

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。

(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)

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又は同条第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)

2023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
163	163	—

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又は同条第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)

		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		11,781
4	貸出金・有価証券等(うち負債性のもの)の期中の要因別の変動額	非デフォルト状態へ復帰した額
5		1,540
6		償却された額
7		7
8		その他の変動額
9		△5,530
10	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。

(単位：百万円)

		2023年度
項番		額
1	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	21,010
2		デフォルトした額
3		9,680
4	貸出金・有価証券等(うち負債性のもの)の期中の要因別の変動額	非デフォルト状態へ復帰した額
5		1,163
6		償却された額
7		9
8		その他の変動額
9		△4,096
10	2023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)	25,422

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

	2022年度	2023年度
内部格付手法	96.66%	92.28%
事業法人等向け	89.90%	86.07%
リテール向け	2.08%	2.60%
株式等	2.90%	1.44%
購入債権	0.21%	0.17%
その他	1.54%	2.00%
標準的手法	3.33%	7.72%
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。

3. 2023年度の株式等エクスポージャーにおいて、内部格付手法で計測される場合に適用されるリスク・ウェイトと、標準的手法で計測される場合に適用されるリスク・ウェイトが同値の場合については、標準的手法を適用しているものとみなします。

みずほ信託銀行連結の自己資本の充実の状況

(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)

		2022年度											
項番	PD 区分	イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ	ト	チ	リ	ヌ	ル	ラ
		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	CCF・信用 リスク削減 手法適用後 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
ソブリン向けエクスポージャー													
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
金融機関等向けエクスポージャー													
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
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	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
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	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
特定貸付債権													
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
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	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)

(続き)

(単位：百万円、%、千件、年)

		2022年度											
項番	PD 区分	イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ	ト	チ	リ	ヌ	ル	ラ
		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	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. 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。
2. 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・与信を除く)においては、債権の数を開示しています。

みずほ信託銀行連結の自己資本の充実の状況

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(先進的内部格付手法適用分) (単位：百万円、%、千件、年)

項番	PD 区分	2023年度											
		イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ	ト	チ	リ	ヌ	ル	ヲ
		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	CCF・信用リスク削減手法適用後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
ソブリン向けエクスポージャー													
1	0.00以上0.15未満	1,146,289	15,007	10.00	1,147,790	—	0.0	36.77	0.2	1,253	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	34	—	—	34	1.23	0.0	36.78	1.0	22	65.47	0	／
6	2.50以上10.00未満	12	—	—	12	2.70	0.0	36.78	1.7	11	94.34	0	／
7	10.00以上100.00未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	／
8	100.00(デフォルト)	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	／
9	小計	1,146,336	15,007	10.00	1,147,837	0.00	0.0	36.77	0.2	1,288	0.11	1	0
金融機関等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	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
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	297,386	17,385	58.08	307,484	0.06	0.0	36.33	3.3	71,084	23.11	74	／
2	0.15以上0.25未満	8,095	1,193	12.34	8,242	0.18	0.0	34.42	2.5	2,706	32.83	5	／
3	0.25以上0.50未満	7,316	810	59.80	7,801	0.41	0.0	23.71	2.3	2,288	29.32	7	／
4	0.50以上0.75未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	／
5	0.75以上2.50未満	23,621	2,224	73.13	25,248	1.18	0.0	20.11	3.6	11,528	45.65	60	／
6	2.50以上10.00未満	7,361	100	10.00	7,371	2.77	0.0	16.73	4.0	3,847	52.20	34	／
7	10.00以上100.00未満	2,624	—	—	2,624	12.95	0.0	32.33	3.1	4,108	156.55	109	／
8	100.00(デフォルト)	798	50	40.00	818	100.00	0.0	24.22	1.2	97	11.87	198	／
9	小計	347,204	21,763	56.91	359,592	0.53	0.2	34.42	3.3	95,662	26.60	490	281
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	7,700	1,300	10.00	7,830	0.13	0.0	35.95	2.0	1,756	22.43	3	／
2	0.15以上0.25未満	12,028	290	10.00	12,057	0.18	0.0	15.47	4.0	1,662	13.79	3	／
3	0.25以上0.50未満	17,022	883	91.28	17,829	0.41	0.0	13.11	4.4	3,314	18.59	9	／
4	0.50以上0.75未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	／
5	0.75以上2.50未満	103,572	4,252	93.24	107,537	1.13	0.4	13.69	4.6	30,279	28.15	170	／
6	2.50以上10.00未満	41,476	689	13.91	41,572	2.70	0.1	11.68	4.9	12,794	30.77	131	／
7	10.00以上100.00未満	2,865	—	—	2,865	12.95	0.0	12.73	4.2	1,509	52.68	47	／
8	100.00(デフォルト)	105	—	—	105	100.00	0.0	10.00	1.0	—	—	10	／
9	小計	184,770	7,415	67.78	189,796	1.54	0.7	14.21	4.5	51,317	27.03	376	216
特定貸付債権													
1	0.00以上0.15未満	535,491	—	—	535,491	0.06	0.1	29.42	3.9	107,602	20.09	100	／
2	0.15以上0.25未満	9,299	—	—	9,299	0.18	0.0	27.84	4.8	3,662	39.38	4	／
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	8,100	—	—	8,100	0.80	0.0	28.41	3.6	5,065	62.53	18	／
6	2.50以上10.00未満	1,641	41	10.00	1,646	2.70	0.0	36.78	5.0	2,099	127.51	16	／
7	10.00以上100.00未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	／
8	100.00(デフォルト)	570	—	—	570	100.00	0.0	84.69	2.2	39	6.87	482	／
9	小計	555,103	41	10.00	555,107	0.18	0.1	29.45	3.9	118,469	21.34	623	358
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	9,723	—	—	9,723	0.13	0.0	90.00	5.0	11,148	114.64	／	／
2	0.15以上0.25未満	5,293	—	—	5,293	0.18	0.0	90.00	5.0	7,037	132.93	／	／
3	0.25以上0.50未満	2,271	—	—	2,271	0.41	0.0	90.00	5.0	4,281	188.45	／	／
4	0.50以上0.75未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	／	／
5	0.75以上2.50未満	1,766	—	—	1,766	1.08	0.0	90.00	5.0	4,557	258.02	／	／
6	2.50以上10.00未満	1,136	—	—	1,136	4.04	0.0	90.00	5.0	4,507	396.56	／	／
7	10.00以上100.00未満	185	—	—	185	12.95	0.0	90.00	5.0	1,162	625.09	／	／
8	100.00(デフォルト)	278	—	—	278	100.00	0.0	90.00	5.0	3,127	1,125.00	／	／
9	小計	20,656	—	—	20,656	1.93	0.2	90.00	5.0	35,821	173.42	／	／

(次ページへ続く)

(続き)

(単位：百万円、%、千件、年)

		2023年度											
項番	PD 区分	イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ	ト	チ	リ	ヌ	ル	ヲ
		オン・バランスシート・グロスの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	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	/
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(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	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	/
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	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	/
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	12	-	-	12	0.13	0.0	43.99	/	1	13.10	0	/
2	0.15以上0.25未満	21	-	-	21	0.21	0.0	44.14	/	4	18.35	0	/
3	0.25以上0.50未満	7,995	-	-	7,995	0.33	0.9	43.87	/	2,059	25.75	11	/
4	0.50以上0.75未満	13,593	-	-	13,593	0.57	2.1	43.87	/	5,094	37.47	34	/
5	0.75以上2.50未満	13,658	-	-	13,658	0.96	0.3	43.87	/	7,344	53.76	57	/
6	2.50以上10.00未満	385	-	-	385	8.67	0.0	43.87	/	723	187.82	14	/
7	10.00以上100.00未満	495	-	-	495	54.31	0.0	43.87	/	945	190.96	117	/
8	100.00(デフォルト)	450	-	-	450	100.00	0.0	40.30	/	351	78.12	181	/
9	小計	36,614	-	-	36,614	2.70	3.6	43.82	/	16,525	45.13	418	240
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	13	-	-	13	0.10	0.0	58.09	/	1	13.52	0	/
2	0.15以上0.25未満	13	-	-	13	0.22	0.0	43.87	/	2	19.34	0	/
3	0.25以上0.50未満	91,751	-	-	91,751	0.30	2.4	50.83	/	24,877	27.11	141	/
4	0.50以上0.75未満	529	-	-	529	0.72	0.5	82.25	/	382	72.19	3	/
5	0.75以上2.50未満	905	-	-	905	1.66	0.2	43.87	/	486	53.78	6	/
6	2.50以上10.00未満	-	-	-	-	-	-	/	-	-	-	-	/
7	10.00以上100.00未満	384	-	-	384	23.86	0.0	60.53	/	527	137.27	54	/
8	100.00(デフォルト)	692	-	-	692	100.00	0.0	48.25	/	664	95.94	333	/
9	小計	94,289	-	-	94,289	1.14	3.3	50.96	/	26,942	28.57	540	310
合計(全てのポートフォリオ)		2,384,975	44,227	42.77	2,403,894	0.34	8.4	33.30	2.2	346,026	14.39	2,449	1,408

注) 1. 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後のPD推計値に基づき、PD区分に割り当てています。
2. 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。
3. 株式等エクスポージャーにおいて、内部格付手法で計測される場合に適用されるリスク・ウェイトと、標準的手法で計測される場合に適用されるリスク・ウェイトが同値の場合については、標準的手法を適用しているものとみなします。

みずほ信託銀行連結の自己資本の充実の状況

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(基礎的内部格付手法適用分) (単位：百万円、%、千件、年)

項番	PD 区分	2023年度											
		イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ	ト	チ	リ	ヌ	ル	ヲ
		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	CCF・信用 リスク削減 手法適用後 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
ソブリン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	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
金融機関等向けエクスポージャー													
1	0.00以上0.15未満	241,582	45,167	10.07	246,134	0.05	0.0	44.97	1.0	39,403	16.00	56	/
2	0.15以上0.25未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	/
3	0.25以上0.50未満	4,091	10,000	10.00	5,091	0.41	0.0	44.63	1.3	3,228	63.41	9	/
4	0.50以上0.75未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	/
5	0.75以上2.50未満	2,263	-	-	2,263	1.97	0.0	42.08	0.5	1,841	81.34	19	/
6	2.50以上10.00未満	112	132,102	10.00	13,322	2.70	0.0	44.78	1.0	14,089	105.75	161	/
7	10.00以上100.00未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	/
8	100.00(デフォルト)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	/
9	小計	248,050	187,269	10.01	266,812	0.20	0.0	44.93	1.0	58,562	21.94	247	142
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	1,538,143	374,680	37.36	1,678,124	0.06	0.3	40.57	2.6	363,327	21.65	418	/
2	0.15以上0.25未満	73,605	6,200	40.00	76,085	0.18	0.0	38.53	1.9	24,478	32.17	55	/
3	0.25以上0.50未満	1,948	-	-	1,948	0.41	0.0	32.82	2.7	919	47.19	2	/
4	0.50以上0.75未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	/
5	0.75以上2.50未満	11,682	2,290	44.36	12,698	0.98	0.0	37.04	1.7	8,311	65.45	44	/
6	2.50以上10.00未満	25,564	6,250	40.00	28,064	3.11	0.0	40.00	1.2	33,536	119.49	349	/
7	10.00以上100.00未満	131	-	-	131	12.95	0.0	25.75	1.0	147	111.85	4	/
8	100.00(デフォルト)	17,701	380	16.33	17,763	100.00	0.0	-	1.6	-	-	5,880	/
9	小計	1,668,777	389,800	37.46	1,814,816	1.10	0.3	40.05	2.5	430,721	23.73	6,755	3,882
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	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	/
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	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
特定貸付債権													
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	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	/
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	2023年度											
		イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ	ト	チ	リ	ヌ	ル	ヲ
		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	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	8,637	—	—	8,637	0.05	0.0	40.00	0.1	459	5.32	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	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
7	10.00以上100.00未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
8	100.00(デフォルト)	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
9	小計	8,637	—	—	8,637	0.05	0.0	40.00	0.1	459	5.32	1	0
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	4,274	—	—	4,274	0.05	0.0	45.00	—	479	11.21	0	—
2	0.15以上0.25未満	4,510	—	—	4,510	0.18	0.0	45.00	—	1,302	28.86	3	—
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	8,785	—	—	8,785	0.12	0.0	45.00	—	1,781	20.27	4	—
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	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
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	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
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	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
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)		1,934,250	577,069	28.55	2,099,051	0.97	0.4	40.69	2.3	491,524	23.41	7,008	4,025

注) 1. 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後のPD推計値に基づき、PD区分に割り当てています。
2. 株式等エクスポージャーにおいて、内部格付手法で計測される場合に適用されるリスク・ウェイトと、標準的手法で計測される場合に適用されるリスク・ウェイトが同値の場合については、標準的手法を適用しているものとみなします。

みずほ信託銀行連結の自己資本の充実の状況

(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			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. 資産の規模は、会計上の資産の増減、新規事業の取り組みによる資産の増加及び債権の満期到来による資産の減少等に起因するリスク・アセットの変動額です。
 2. ポートフォリオの質は、債務者及び案件の格付区分の遷移、担保価値及び保証の変動等に起因するリスク・アセットの変動額です。
 3. 手法及び方針は、当局による規制の変更による計算手法の変更に起因するリスク・アセットの変動額です。
 4. 為替の変動は、外貨建取引のエクスポージャーが為替変動の影響を受けることに起因するリスク・アセットの変動額です。

(単位：億円)

項番			2023年度
			信用リスク・アセットの額
1	2022年度末時点における信用リスク・アセットの額		11,714
2	期中の要因別の変動額	資産の規模	△486
3		ポートフォリオの質	221
4		モデルの更新	—
5		手法及び方針	△183
6		買収又は売却	—
7		為替の変動	1
8		その他	△0
9		2023年度末時点における信用リスク・アセットの額	

- 注) 1. 資産の規模は、会計上の資産の増減、新規事業の取り組みによる資産の増加及び債権の満期到来による資産の減少等に起因するリスク・アセットの変動額です。
 2. ポートフォリオの質は、債務者及び案件の格付区分の遷移、担保価値及び保証の変動等に起因するリスク・アセットの変動額です。
 3. 手法及び方針は、当局による規制の変更による計算手法の変更に起因するリスク・アセットの変動額です。
 4. 為替の変動は、外貨建取引のエクスポージャーが為替変動の影響を受けることに起因するリスク・アセットの変動額です。
 5. 株式等エクスポージャーにおいて、内部格付手法で計測される場合に適用されるリスク・ウェイトと、標準的手法で計測される場合に適用されるリスク・ウェイトが同値の場合については、標準的手法を適用しているものとみなします。

(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)

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 相加重平均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	
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~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	/	/	/	/	/	—	—	—	—	—	—	—	
住宅用不動産向け	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. ソブ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。

2. 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。

3. 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%。

4. 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(事業性や信を除く)においては、債権の数を開示しています。

5. 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

(単位：％、件)

2023年度													
ポートフォリオ	PD 区分	相当する外部格付					加重平均PD (EAD加重)	相加重平均PD	債務者の数		期中にデフォルトした債務者の数	うち、期中にデフォルトした新たな債務者の数	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-	0.05	0.06	571	545	—	—	—
	0.10以上 0.20未満	BBB+~ BBB-	Baa1~ Baa3	BBB+~ BBB-	BBB+~ BBB-	BBB+~ BBB-	0.15	0.17	225	206	—	—	—
	0.20以上 1.00未満	BB+~BB-	Ba1~Ba3	BB+~BB-	BB+~BB-	BB+~BB-	0.56	0.56	475	454	—	—	0.21
	1.00以上 5.00未満	B+~B-	B1~B3	B+~B-	B+~B-	B+~B-	2.07	2.70	526	474	2	—	0.25
	5.00以上 100.00未満	CCC+~ CCC-	Caa1~ Caa3	CCC+~ CCC-	CCC+~ CCC-	CCC~C	9.55	12.45	44	34	1	—	3.16
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	/	/	/	/	/	—	—	—	—	—	—	—
住宅用不動産向け	0.00以上 0.10未満	/	/	/	/	/	—	—	—	—	—	—	—
	0.10以上 0.20未満	/	/	/	/	/	—	—	—	—	—	—	—
	0.20以上 1.00未満	/	/	/	/	/	0.46	0.47	2,560	2,259	3	—	0.17
	1.00以上 5.00未満	/	/	/	/	/	1.14	1.12	259	244	—	—	0.07
	5.00以上 100.00未満	/	/	/	/	/	15.09	15.76	100	109	10	—	9.37
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	/	/	/	/	/	0.85	0.72	3,428	3,245	10	—	0.23
	1.00以上 5.00未満	/	/	/	/	/	2.73	3.01	379	379	4	—	0.93
	5.00以上 100.00未満	/	/	/	/	/	14.60	22.03	85	87	16	—	17.54

注) 1. ソブ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。

2. 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。

3. 先進的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76%、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%。

4. 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。

5. バックテストの対象期間は2022年9月末~2023年9月末です。

6. 株式等エクスポージャーにおいて、内部格付手法で計測される場合に適用されるリスク・ウェイトと、標準的手法で計測される場合に適用されるリスク・ウェイトが同値の場合については、標準的手法を適用しているものとみなします。

(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、%)

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		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%		—	—				

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、%)

2023年度												
イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ	ト	チ	リ	ヌ	ル	ラ	
特定貸付債権(スロットティング・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		—	—	—		—	—	—	—	—	—	

(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)

		2022年度											
		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)											
項番	資産クラス	リスク・ウェイト	0%	10%	20%	35%	50%	75%	100%	150%	250%	1250%	合計
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

(B) CR5a：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)

		2023年度									
		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)									
資産クラス	リスクウェイト	0%	20%	50%	100%	150%	その他	合計			
1a	日本国政府及び日本銀行向け	11,472	—	—	—	—	—	11,472			
1b	外国の中央政府及び中央銀行向け	48,332	—	—	—	—	—	48,332			
1c	国際決済銀行等向け	—	—	—	—	—	—	—			
		0%	10%	20%	50%	100%	150%	その他	合計		
2a	我が国の地方公共団体向け	1	—	—	—	—	—	—	1		
2b	外国の中央政府等以外の公共部門向け	—	—	—	—	—	—	—	—		
2c	地方公共団体金融機構向け	—	—	—	—	—	—	—	—		
2d	我が国の政府関係機関向け	—	—	—	—	—	—	—	—		
2e	地方三公社向け	—	—	—	—	—	—	—	—		
		0%	20%	30%	50%	100%	150%	その他	合計		
3	国際開発銀行向け	—	—	—	—	—	—	—	—		
		20%	30%	40%	50%	75%	100%	150%	その他	合計	
4	金融機関、第一種金融商品取引業者及び保険会社向け	101,131	7,665	217	3,728	—	63	—	—	112,806	
	うち、第一種金融商品取引業者及び保険会社向け	—	349	—	—	—	—	—	—	349	
		10%	15%	20%	25%	35%	50%	100%	その他	合計	
5	カバード・ボンド向け	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
		20%	50%	75%	80%	85%	100%	130%	150%	その他	合計
6	法人等向け（特定貸付債権向けを含む。）	—	—	—	—	—	1,026	—	—	—	1,026
	うち、特定貸付債権向け	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
		100%	150%	250%	400%	—	—	—	その他	合計	
7a	劣後債権及びその他資本性証券等	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
7b	株式等	164,179	—	—	—	—	—	—	—	—	164,179
		45%	75%	100%	—	—	—	—	その他	合計	
8	中堅中小企業等向け及び個人向け	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
		20%	25%	30%	40%	50%	70%	75%	その他	合計	
9a	不動産関連向け うち、自己居住用不動産等向け	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
	うち、抵当権が第二順位以下で適格要件をみたすもの	20%	31.25%	37.5%	50%	62.5%	—	—	—	—	
		30%	35%	45%	60%	75%	105%	150%	その他	合計	
9b	不動産関連向け うち、賃貸用不動産向け	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
	うち、抵当権が第二順位以下で適格要件をみたすもの	30%	43.75%	56.25%	75%	93.75%	—	—	—	—	
		70%	90%	110%	150%	—	—	—	その他	合計	
9c	不動産関連向け うち、事業用不動産関連	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
	うち、抵当権が第二順位以下で適格要件をみたすもの	70%	112.5%	—	—	—	—	—	—	—	
		60%	—	—	—	—	—	—	その他	合計	
9d	不動産関連向け うち、その他不動産関連	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
	うち、抵当権が第二順位以下で適格要件をみたすもの	—	60%	—	—	—	—	—	—	—	
		100%	150%	—	—	—	—	—	その他	合計	
9e	不動産関連向け うち、ADC向け	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
		50%	100%	150%	—	—	—	—	その他	合計	
10a	延滞等(自己居住用不動産等向けエクスポージャーを除く。)	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
10b	自己居住用不動産等向けエクスポージャーに係る延滞	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
		0%	10%	20%	—	—	—	—	その他	合計	
11a	現金	0	—	—	—	—	—	—	—	0	
11b	取立未済手形	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
	信用保証協会等による保証付	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
	株式会社地域経済活性化支援機構等による保証付	—	—	—	—	—	—	—	—	—	

注) 株式等エクスポージャーにおいて、内部格付手法で計測される場合に適用されるリスク・ウェイトと、標準的手法で計測される場合に適用されるリスク・ウェイトが同値の場合については、標準的手法を適用しているものとみなします。

みずほ信託銀行連結の自己資本の充実の状況

(C) CR5b：標準的手法－リスク・ウェイト区分別の信用リスク・エクスポージャーとCCF

(単位：百万円)

項番	リスク・ウェイト	2023年度			
		イ	ロ	ハ	ニ
		オン・バランスシートの エクスポージャーの額	オフ・バランスシートの エクスポージャーの額	CCFの加重平均値	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)
1	40%未満	168,603	—	—	168,603
2	40%-70%	3,946	—	—	3,946
3	75%	—	—	—	—
	80%	—	—	—	—
4	85%	—	—	—	—
5	90%-100%	165,269	—	—	165,269
6	105%-130%	—	—	—	—
7	150%	—	—	—	—
8	250%	—	—	—	—
9	400%	—	—	—	—
10	1250%	—	—	—	—
11	合計	337,819	—	—	337,819

注) 株式等エクスポージャーにおいて、内部格付手法で計測される場合に適用されるリスク・ウェイトと、標準的手法で計測される場合に適用されるリスク・ウェイトが同値の場合については、標準的手法を適用しているものとみなします。

(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		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。

(単位：百万円)

項番		2023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	2,127,384	724,654	569,050	26,921	—
2	有価証券(負債性のもの)	29,798	61,766	47,566	—	—
3	その他オン・バランスシートの資産 (負債性のもの)	1,317,813	—	—	—	—
4	合計 (1 + 2 + 3)	3,474,995	786,421	616,616	26,921	—
5	うちデフォルトしたもの	10,078	10,320	4,336	5,151	—

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	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	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	—	20,978	—	22.29	—	22.29	
12	法人等向け	1,116	—	1,116	—	1,116	—	1,116	—	100.00	—	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	—	22,095	—	14.87	—	14.87	

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、%)

項番	資産クラス	2023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	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
1a	日本国政府及び日本銀行向け	11,472	—	11,472	—	—	—	—	—	—	—	—	
1b	外国の中央政府及び中央銀行向け	48,332	—	48,332	—	—	—	—	—	—	—	—	
1c	国際決済銀行等向け	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
2a	我が国の地方公共団体向け	1	—	1	—	—	—	—	—	—	—	—	
2b	外国の中央政府等以外の公共部門向け	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
2c	地方公共団体金融機構向け	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
2d	我が国の政府関係機関向け	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
2e	地方三公社向け	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
3	国際開発銀行向け	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
4	金融機関、第一種金融商品取引業者及び保険会社向け	112,806	—	112,806	—	24,540	21.75	—	—	—	—	—	
	うち、第一種金融商品取引業者及び保険会社向け	349	—	349	—	104	30.00	—	—	—	—	—	
5	カバード・ボンド向け	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
6	法人等向け(特定貸付債権向けを含む。)	1,026	—	1,026	—	1,026	100.00	—	—	—	—	—	
	うち、特定貸付債権向け	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
7a	劣後債権及びその他資本性証券等	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
7b	株式等	164,179	—	164,179	—	164,179	100.00	—	—	—	—	—	
8	中堅中小企業等向け及び個人向け	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
	うち、トランザクター向け	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
9	不動産関連向け	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
	うち、自己居住用不動産等向け	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
	うち、賃貸用不動産向け	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
	うち、事業用不動産関連	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
	うち、その他不動産関連	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
	うち、ADC向け	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
10a	延滞等(自己居住用不動産等向けエクスポージャーを除く。)	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
10b	自己居住用不動産等向けエクスポージャーに係る延滞	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
11a	現金	0	—	0	—	—	—	—	—	—	—	—	
11b	取立未済手形	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
	信用保証協会等による保証付	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
	株式会社地域経済活性化支援機構等による保証付	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
12	合計	337,819	—	337,819	—	189,747	56.16	—	—	—	—	—	

注) 株式等エクスポージャーにおいて、内部格付手法で計測される場合に適用されるリスク・ウェイトと、標準的手法で計測される場合に適用されるリスク・ウェイトが同値の場合については、標準的手法を適用しているものとみなします。

(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)

		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
項番	ポートフォリオ		
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

(単位：百万円)

		2023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
項番	ポートフォリオ		
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	774	774
3	金融機関等向けエクスポージャー -FIRB	58,562	58,562
4	金融機関等向けエクスポージャー -AIRB	—	—
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	430,730	430,730
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	146,979	146,979
7	特定貸付債権 -FIRB	—	—
8	特定貸付債権 -AIRB	118,972	118,972
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	16,525	16,525
11	リテール -その他リテール向けエクスポージャー	26,942	26,942
12	購入債権 -FIRB	2,241	2,241
13	購入債権 -AIRB	—	—
14	合計	801,729	801,729

(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)

	2022年度	2023年度
	期末残高	期末残高
ルック・スルー方式	37,750	51,073
マンドート方式	—	—
蓋然性方式250%	—	981
蓋然性方式400%	752	—
フォールバック方式1250%	226	61
合計	38,729	52,116

- 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)

		2022年度					
		イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ
項番		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 α	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 カレント・エクスポージャー方式	—	—	/	1.4	—	—
2	期待エクスポージャー方式	/	49	/	/	49	1
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

(単位：百万円)

		2023年度					
		イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ
項番		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 α	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	—	—
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	/	/	/	/	1,120	693
4	信用リスク削減手法における包括的手法	/	/	/	/	43,823	1
5	エクスポージャー変動推計モデル	/	/	/	/	—	—
6	合計	/	/	/	/	/	695

注) 1. RC、PFEは財務会計において認識されたCVAを控除していない数値になります。

2. 信用リスク削減手法適用後のエクスポージャーは財務会計において認識されたCVAを控除した数値になります。

3. 信用リスク削減手法における包括的手法には、担保提供資産の一部が含まれます。

(B) CCR2：CVAリスクに対する資本賦課

(単位：百万円)

		2022年度	
		イ	ロ
項番		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バリュアット・リスクの額(乗数適用後)	/	—
3	(ii) CVAストレス・バリュアット・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	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

(単位：百万円)

項番	業種	リスク・ウェイト	2023年度													合計	
			イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ	ト	チ	リ	ヌ	ル	ヲ	カ		
			与信相当額(信用リスク削減効果勘案後)														
			0%	10%	20%	30%	40%	50%	75%	80%	85%	100%	130%	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、第一種金融商品取引業者及び保険会社向け		—	—	242	60	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	303
11	法人等向け		—	—	—	—	—	—	—	—	—	37	—	—	—	—	37
12	中小企業等向け及び個人向け		—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
13	上記以外		—	—	—	—	—	—	—	—	—	590	—	—	—	—	590
14	合計		190	—	242	60	—	—	—	—	—	627	—	—	—	—	1,120

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		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)
ソブリン向けエクスポージャー								
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
金融機関等向けエクスポージャー								
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
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	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
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	—	—	—	—	—	—	—
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	—	—	—	—	—	—	—
特定貸付債権								
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)

		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)	
購入債権								
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	—	—	—	—	—	—	—
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	—	—	—	—	/	—	—
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

みずほ信託銀行連結の自己資本の充実の状況

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(先進的内部格付手法適用分)
(単位：百万円、%、千件、年)

項番 PD区分		2023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)
ソブリン向けエクスポージャー								
1	0.00 以上0.15 未満	43,812	—	0.0	36.78	5.0	—	—
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	43,812	—	0.0	36.78	5.0	—	—
金融機関等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	—	—	—	—	—	—	—
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	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	—	—	—	—	—	—	—
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	—	—	—	—	—	—	—
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	—	—	—	—	—	—	—
特定貸付債権								
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	2023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)	
購入債権								
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	—	—	—	—	—	—	—
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	—	—	—	—	/	—	—
合計(全てのポートフォリオ)		43,812	—	0.0	36.78	5.0	—	—

みずほ信託銀行連結の自己資本の充実の状況

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(基礎的内部格付手法適用分)
(単位：百万円、%、千件、年)

項番 PD区分		2023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)
ソブリン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	—	—	—	—	—	—	—
金融機関等向けエクスポージャー								
1	0.00 以上0.15 未満	11	0.05	0.0	45.00	0.3	1	10.28
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	11	0.05	0.0	45.00	0.3	1	10.28
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	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	—	—	—	—	—	—	—
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	—	—	—	—	—	—	—
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	—	—	—	—	—	—	—
特定貸付債権								
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	2023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)
購入債権								
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	—	—	—	—	—	—	—
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	—	—	—	—	—	—	—
合計(全てのポートフォリオ)		11	0.05	0.0	45.00	0.3	1	10.28

(E) CCR5：担保の内訳

(単位：百万円)

項番		2022年度					
		派生商品取引で使用される担保				レポ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

(単位：百万円)

項番		2023年度					
		派生商品取引で使用される担保				レポ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)	—	16,315	—	16,500	—	20,066
2	現金(外国通貨)	—	—	—	—	—	—
3	国内ソブリン債	—	—	—	—	20,055	—
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	—	—	—	—	—	—
9	合計	—	16,315	—	16,500	20,055	20,066

みずほ信託銀行連結の自己資本の充実の状況

(F) ENC1：担保資産の状況

(単位：百万円)

項番		2023年度			
		イ	ロ	ハ	ニ
		担保に供されている 資産の額	担保に供されていない 資産の額	合計	うち、証券化エクスポージャーの額
1	現金預け金	—	1,293,384	1,293,384	—
2	債券貸借取引支払保証金	—	20,066	20,066	—
3	買入金銭債権	—	23,296	23,296	1,963
4	金銭の信託	—	30,298	30,298	—
5	有価証券	—	299,872	299,872	—
6	貸出金	43,812	2,813,451	2,857,263	1,500
7	外国為替	—	5,271	5,271	—
8	その他資産	83,732	275,132	358,864	—
9	有形固定資産	—	95,526	95,526	—
10	無形固定資産	—	31,465	31,465	—
11	退職給付に係る資産	—	141,385	141,385	—
12	繰延税金資産	—	981	981	—
13	支払承諾見返	—	14,142	14,142	—
14	貸倒引当金	—	△5,279	△5,279	—
15	合計	127,544	5,038,995	5,166,539	3,463

(G) 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		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
想定元本			
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	想定元本合計	—	—
公正価値			
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		2023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
想定元本			
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	想定元本合計	—	—
公正価値			
7	プラスの公正価値(資産)	—	—
8	マイナスの公正価値(負債)	—	—

(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	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。)	569
3	(i) 派生商品取引(上場以外)	569
4	(ii) 派生商品取引(上場)	—
5	(iii) レポ形式の取引	—
6	(iv) クロスプロダクト・ネットティングが承認された場合のネットティング・セット	—
7	分別管理されている当初証拠金	—
8	分別管理されていない当初証拠金	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) レポ形式の取引	—
16	(iv) クロスプロダクト・ネットティングが承認された場合のネットティング・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	2023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)	571
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。)	571
3	(i) 派生商品取引(上場以外)	571
4	(ii) 派生商品取引(上場)	—
5	(iii) レポ形式の取引	—
6	(iv) クロスプロダクト・ネットティングが承認された場合のネットティング・セット	—
7	分別管理されている当初証拠金	—
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) レポ形式の取引	—
16	(iv) クロスプロダクト・ネットティングが承認された場合のネットティング・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

■CVAリスク

(1) CVAリスクに関する定量的開示事項

(A) CVA1：限定的なBA-CVA

(単位：百万円)

		2023年度	
項番		イ 構成要素の額	ロ BA-CVAによるCVAリスク相当額
1	CVAリスクのうち取引先共通の要素	—	—
2	CVAリスクのうち取引先固有の要素	—	—
3	合計	—	—

■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)

		2022年度								
項番	原資産の種類	イ 自金融機関がオリジネーター			ロ 自金融機関がスポンサー			ハ 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	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	—	—	—	—	—	—	—	—	—

(単位：百万円)

		2023年度								
項番	原資産の種類	イ 自金融機関がオリジネーター			ロ 自金融機関がスポンサー			ハ 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)	—	—	—	5,000	—	5,000	—
2	担保付住宅ローン	—	—	—	—	—	—	—	—	—
3	クレジットカード債権	—	—	—	5,000	—	5,000	—	—	—
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)	—	—	—	1,963	—	1,963	—	—	—
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	—	—	—	1,963	—	1,963	—	—	—
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)

		2022年度								
		イ			ロ			ハ		
		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	リテール(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)

		2023年度								
		イ			ロ			ハ		
		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	リテール(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	—	—	—	—	—	—	—	—	—

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)

		2022年度							
		イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ	ト	チ
項番	合計	証券化							
		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		シニア		非シニア	
エクスポージャーの額(リスク・ウェイト区分別)									
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	—	—	—	—	—	—	—	—
エクスポージャーの額(算出方法別)									
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	—	—	—	—	—	—	—	—
信用リスク・アセットの額(算出方法別)									
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	—	—	—	—	—	—	—	—
所要自己資本の額(算出方法別)									
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	
項番	合計	証券化							
		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		シニア		非シニア	
エクスポージャーの額(リスク・ウェイト区分別)									
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	—	—	—	—	—	—	—	—
エクスポージャーの額(算出方法別)									
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	—	—	—	—	—	—	—	—
信用リスク・アセットの額(算出方法別)									
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	—	—	—	—	—	—	—	—
所要自己資本の額(算出方法別)									
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)

項番		2023年度							
		イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ	ト	チ
		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		
								シニア	非シニア
エクスポージャーの額(リスク・ウェイト区分別)									
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	1,963	1,963	1,963	—	1,963	—	—	—
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	5,000	5,000	5,000	5,000	—	—	—	—
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	—	—	—	—	—	—	—	—
エクスポージャーの額(算出方法別)									
6	内部格付手法準拠方式が適用される証券化エクスポージャー	6,963	6,963	6,963	5,000	1,963	—	—	—
7	外部格付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	—	—	—	—	—	—	—	—
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	—	—	—	—	—	—	—	—
信用リスク・アセットの額(算出方法別)									
10	内部格付手法準拠方式により算出した信用リスク・アセット	3,308	3,308	3,308	3,014	294	—	—	—
11	外部格付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	—	—	—	—	—	—	—	—
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	—	—	—	—	—	—	—	—
所要自己資本の額(算出方法別)									
14	内部格付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	264	264	264	241	23	—	—	—
15	外部格付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	—	—	—	—	—	—	—	—
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	—	—	—	—	—	—	—	—

項番		2023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			
						裏付けとなる リート	ホールセール		
								シニア	非シニア
エクスポージャーの額(リスク・ウェイト区分別)									
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	—	—	—	—	—	—	—	—
エクスポージャーの額(算出方法別)									
6	内部格付手法準拠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	—	—	—	—	—	—	—	—
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	—	—	—	—	—	—	—	—
信用リスク・アセットの額(算出方法別)									
10	内部格付手法準拠方式により算出した信用リスク・アセット	—	—	—	—	—	—	—	—
11	外部格付準拠方式又は内部評価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	—	—	—	—	—	—	—	—
所要自己資本の額(算出方法別)									
14	内部格付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	—	—	—	—	—	—	—	—
15	外部格付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	—	—	—	—	—	—	—	—
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)

		2022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				
		証券化取引(小計)	証券化	裏付けとなるホールセールリテール		再証券化	シニア 非シニア			
				裏付けとなるリテール	ホールセール		シニア	非シニア		
エクスポージャーの額(リスク・ウェイト区分別)										
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	—	—	—	—	—	—	—	—	
エクスポージャーの額(算出方法別)										
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	—	—	—	—	—	—	—	—	
信用リスク・アセットの額(算出方法別)										
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	—	—	—	—	—	—	—	—	
所要自己資本の額(算出方法別)										
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	—	—	—	—	—	—	—	—	

		2022年度								
		リ	ヌ	ル	ラ	ワ	カ	ヨ		
項番	合計	合成型証券化取引(小計)		証券化		再証券化				
		証券化取引(小計)	証券化	裏付けとなるホールセールリテール		再証券化	シニア 非シニア			
				裏付けとなるリテール	ホールセール		シニア	非シニア		
エクスポージャーの額(リスク・ウェイト区分別)										
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	—	—	—	—	—	—	—	—	
エクスポージャーの額(算出方法別)										
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	—	—	—	—	—	—	—	—	
信用リスク・アセットの額(算出方法別)										
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	—	—	—	—	—	—	—	—	
所要自己資本の額(算出方法別)										
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)

		2023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 ホールセール リテール		再証券化	シニア 非シニア		
項番									
エクスポージャーの額(リスク・ウェイト区分別)									
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	—	—	—	—	—	—	—	—
エクスポージャーの額(算出方法別)									
6	内部格付手法準拠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	—	—	—	—	—	—	—	—
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	—	—	—	—	—	—	—	—
信用リスク・アセットの額(算出方法別)									
10	内部格付手法準拠方式により算出した信用リスク・アセット	—	—	—	—	—	—	—	—
11	外部格付準拠方式又は内部評価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	—	—	—	—	—	—	—	—
所要自己資本の額(算出方法別)									
14	内部格付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	—	—	—	—	—	—	—	—
15	外部格付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	—	—	—	—	—	—	—	—
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	—	—	—	—	—	—	—	—

		2023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		
		合成型証券 化取引 (小計)	証券化	裏付けとなる ホールセール リテール		再証券化	シニア 非シニア		
項番									
エクスポージャーの額(リスク・ウェイト区分別)									
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	—	—	—	—	—	—	—	
エクスポージャーの額(算出方法別)									
6	内部格付手法準拠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	—	—	—	—	—	—	—	
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	—	—	—	—	—	—	—	
信用リスク・アセットの額(算出方法別)									
10	内部格付手法準拠方式により算出した信用リスク・アセット	—	—	—	—	—	—	—	
11	外部格付準拠方式又は内部評価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	—	—	—	—	—	—	—	
所要自己資本の額(算出方法別)									
14	内部格付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	—	—	—	—	—	—	—	
15	外部格付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	—	—	—	—	—	—	—	
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

■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		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)
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		3,359
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		3,359

(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) MR3：簡易的方式によるマーケット・リスク相当額

(単位：百万円)

項番		2023年度			
		イ オプション取引 以外の取引	ハ オプション取引		
			ロ 簡便法により 算出した額	ニ デルタ・プラス法 により算出した額	三 シナリオ法により 算出した額
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	コモディティ・リスクの額	—	—	—	—
4	外国為替リスクの額	1,763	—	—	—
5	証券化エクスポージャーに係る個別リスクの額	—	—	—	—
6	合計	1,763	—	—	—

(E) 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			
		2023年度		2022年度		2023年度		2022年度	
1	上方パラレルシフト	7,831	1,519	△15,996	△23,291				
2	下方パラレルシフト	0	2,130	15,136	23,433				
3	スティープ化	4,185	0	/	/				
4	フラット化	0	83	/	/				
5	短期金利上昇	1,395	245	/	/				
6	短期金利低下	0	391	/	/				
7	最大値	7,831	2,130	15,136	23,433				
		ホ				ヘ			
		2023年度		2022年度		2023年度		2022年度	
8	Tier1資本の額	476,624		444,748					

- 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うえ、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。

■オペレーショナル・リスク

(1) BIの算出方法

事業規模指標 (BI) については、自己資本比率告示第305条に基づき、金利要素 (ILDC)、役務要素 (SC) および金融商品要素 (FC) を合計して算出しています。

(2) ILMの算出方法

みずほ信託銀行(株)のILMの算出においては、自己資本比率告示第306条第1項第1号に定める方法を採用しています。自己資本比率告示第306条第1項第4号に定める保守的な見積値を用いる方法を採用しています。

みずほ信託銀行(株)以外の連結子法人等のILMの算出においては、

(3) オペレーショナル・リスク相当額の算出に当たって、BIの算出から除外した連結子法人等又は事業部門の有無該当ありません。

(4) オペレーショナル・リスク相当額の算出に当たって、ILMの算出から除外した特殊損失の有無該当ありません。

みずほ信託銀行連結の自己資本の充実の状況

(5) オペレーショナル・リスクに関する定量的開示事項

(A) OR1：オペレーショナル・リスク損失の推移

(単位：百万円、件)

項番		2023年度										
		イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ	ト	チ	リ	ヌ	ル
		当期末	前期末	前々期末	ハの前期末	ニの前期末	ホの前期末	ヘの前期末	トの前期末	チの前期末	リの前期末	直近十年間の平均
二百万円を超える損失を集計したもの												
1	ネットの損失の合計額 (特殊損失控除前)	99	—	437	2	77	12	—	27	51	24	73
2	損失の件数	4	—	6	1	4	2	—	6	4	3	3
3	特殊損失の総額	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
4	特殊損失の件数	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
5	ネットの損失の合計額 (特殊損失控除後)	99	—	437	2	77	12	—	27	51	24	73
千万円を超える損失を集計したもの												
6	ネットの損失の合計額 (特殊損失控除前)	86	—	415	—	72	—	—	—	33	11	61
7	損失の件数	1	—	2	—	2	—	—	—	1	1	—
8	特殊損失の総額	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
9	特殊損失の件数	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
10	ネットの損失の合計額 (特殊損失控除後)	86	—	415	—	72	—	—	—	33	11	61
オペレーショナル・リスク相当額の計測に関する事項												
11	ILMの算出への内部損失データ利用の有無	有	有	有	有	有	有	有	有	有	有	有
12	項番11で内部損失データを利用していない場合は、内部損失データの承認基準充足の有無	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—

注) みずほ信託銀行(株)以外の連結子会社については、自己資本比率告示第310条第1項の基準を満たさないため、ILMに保守的な見積値を用いています。

(B) OR2：BICの構成要素

(単位：百万円)

項番		2023年度		
		イ	ロ	ハ
		当期末	前期末	前々期末
1	ILDC	21,564	—	—
2	資金運用収益	27,027	23,328	22,278
3	資金調達費用	8,760	7,025	7,053
4	金利収益資産	3,122,615	3,308,793	3,422,004
5	受取配当金	4,588	4,455	4,490
6	SC	168,721	—	—
7	役務取引等収益	166,894	159,785	169,683
8	役務取引等費用	40,557	38,830	37,839
9	その他業務収益	—	—	347
10	その他業務費用	20	99	3
11	FC	5,450	—	—
12	特定取引勘定のネット損益 (特定取引等のネット損益)	66	△32	△624
13	特定取引勘定以外の勘定のネット損益 (特定取引等以外の勘定のネット損益)	6,866	3,915	4,383
14	BI	195,736	—	—
15	BIC	25,215	—	—
16	除外特例の対象となる連結子法人等又は事業部門を含むBI	195,736	—	—
17	除外特例によって除外したBI	—	—	—

注) 自己資本比率告示第306条第1項第4号に定めるILMの値に保守的な見積値を用いる連結子会社毎に、同告示第305条第2項に定める算式によりBICを構成する各要素の額を算出しているため、項番1、6、11の各数値は、項番2～5、7～10、12、13の各数値から算出される額とは一致しません。

(C) OR3：オペレーショナル・リスクに対する所要自己資本額の概要

(単位：百万円)

項番		2023年度	
		イ	ロ
1	BIC	25,215	—
2	ILM	0.66	—
3	オペレーショナル・リスク相当額	16,867	—
4	オペレーショナル・リスク・アセットの額	210,849	—

■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	2022年度
1. オン・バランス資産の額			
1		調整項目控除前のオン・バランス資産の額	4,032,589
1a	1	連結貸借対照表における総資産の額	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(△)	58,336
2	7	Tier1資本に係る調整項目の額(△)	114,050
3		オン・バランス資産の額 (イ)	3,918,538
2. デリバティブ取引等に関する額			
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	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	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	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)	31,610
3. レポ取引等に関する額			
12		レポ取引等に関する資産の額	20,177
13		レポ取引等に関する資産の額から控除した額(△)	—
14		レポ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	39
15		代理取引のエクスポージャーの額	/
16	5	レポ取引等に関する額 (ハ)	20,217
4. オフ・バランス取引に関する額			
17		オフ・バランス取引の想定元本の額	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変換調整の額(△)	262,781
19	6	オフ・バランス取引に関する額 (ニ)	221,035
5. 連結レバレッジ比率			
20		資本の額 (ホ)	444,748
21	8	総エクスポージャーの額((イ)+(ロ)+(ハ)+(ニ)) (ヘ)	4,191,401
22		連結レバレッジ比率(ホ)/(ヘ)	10.61%
		適用する所要連結レバレッジ比率	3.00%
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			
		総エクスポージャーの額 (ヘ)	4,191,401
		日本銀行に対する預け金の額	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')	6,880,498
		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')	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自己資本の充実の状況

(単位：百万円)

項番(国際様式(LR1) の該当番号)	項目	2023年度
1	連結貸借対照表における総資産の額	5,166,539
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(△)	—
3	リスク移転の認識に係る要件を充足しない証券化エクスポージャーに係る調整	—
4	中央銀行預け金に係る除外による調整(△)	1,133,176
5	顧客資産のうち、連結貸借対照表に計上されている金額(△)	/
6	有価証券の売買を約定日基準により会計処理している場合における調整項目	—
7	キャッシュ・プーリング契約に基づく資金の移動に係る調整項目	—
8	デリバティブ取引等に関する調整額	△20,729
8a	デリバティブ取引等に関する額	5,480
8b	デリバティブ取引等に関連する資産の額(△)	26,209
9	レポ取引等に関する調整額	11
9a	レポ取引等に関する額	20,077
9b	レポ取引等に関する額(△)	20,066
10	オフ・バランス取引に関する額	229,307
11	Tier1 資本に係る調整項目の額(貸倒引当金)(△)	4,126
12	その他の調整項目	△137,474
12a	Tier1 資本に係る調整項目の額(貸倒引当金以外)(△)	123,332
12b	支払承諾見返動定の額(△)	14,142
12c	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(相殺した額に相当する部分に限る。)	—
12d	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(△)	—
12e	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。)	—
13	総エクスポージャーの額	4,100,351

(単位：百万円、%)

項番(国際様式(LR2)の該当番号)	項目	2023年度
オン・バランス資産の額 (1)		
1	個別項目調整前のオン・バランス資産の額	3,972,943
2	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(相殺した額に相当する部分に限る。)	—
3	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(△)	—
4	レポ取引等により受領した証券の計上額(△)	—
5	Tier1資本に係る調整項目の額(貸倒引当金)(△)	4,126
6	Tier1資本に係る調整項目の額(貸倒引当金以外)(△)	123,332
7	オン・バランス資産の額 (イ)	3,845,485
デリバティブ取引等に関する額 (2)		
8	デリバティブ取引等に関するRCの額に1.4を乗じた額	—
9	デリバティブ取引等に関するPFEの額に1.4を乗じた額	5,480
10	間接清算参加者に適格中央清算機関の債務履行を保証していない場合に零とした中央清算機関向けエクスポージャーの額(△)	—
11	クレジット・デリバティブ等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	—
12	クレジット・デリバティブ等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(△)	—
13	デリバティブ取引等に関する額 (ロ)	5,480
レポ取引等に関する額 (3)		
14	レポ取引等に関する資産の額	20,066
15	レポ取引等に関する資産の額から控除した額(△)	—
16	レポ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	11
17	代理取引のエクスポージャーの額	/
18	レポ取引等に関する額 (ハ)	20,077
オフ・バランス取引に関する額 (4)		
19	オフ・バランス取引の想定元本の額	668,934
20	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(△)	439,626
22	オフ・バランス取引に関する額 (ニ)	229,307
連結レバレッジ比率 (5)		
23	資本の額 (ホ)	476,624
24	総エクスポージャーの額((イ)+(ロ)+(ハ)+(ニ)) (ヘ)	4,100,351
25	連結レバレッジ比率((ホ)/(ヘ))	11.62%
26	適用する所要連結レバレッジ比率	3.00%
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 (6)		
	総エクスポージャーの額 (ヘ)	4,100,351
	日本銀行に対する預け金の額	1,133,176
	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')	5,233,528
	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'))	9.10%
平均値の開示 (7)		
28	レポ取引等に関する資産の額(控除後)に係る平均値((ト)+(チ))	28,381
	レポ取引等に関する資産の額に係る平均値 (ト)	28,381
	レポ取引等に関する資産の額から控除した額に係る平均値(△) (チ)	—
29	レポ取引等に関する資産の額(控除後)に係る四半期末の値((リ)+(ヌ))	20,066
14	レポ取引等に関する資産の額に係る四半期末の値 (リ)	20,066
15	レポ取引等に関する資産の額から控除した額に係る四半期末の値(△) (ヌ)	—
30	総エクスポージャーの額(レポ取引等に関する資産の額(控除後)に係る平均値を使用し、日本銀行に対する預け金を算入しない場合) (ル)	4,108,665
30a	総エクスポージャーの額(レポ取引等に関する資産の額(控除後)に係る平均値を使用し、日本銀行に対する預け金を算入する場合) (ヲ)	5,241,842
31	連結レバレッジ比率(レポ取引等に関する資産の額(控除後)に係る平均値を使用し、日本銀行に対する預け金を算入しない場合)((ホ)/(ル))	11.60%
31a	連結レバレッジ比率(レポ取引等に関する資産の額(控除後)に係る平均値を使用し、日本銀行に対する預け金を算入する場合)((ホ)/(ヲ))	9.09%

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自己資本の充実の状況

(2) 前連結会計年度の連結レバレッジ比率との間に著しい差異を生じた原因

普通株式等Tier1資本の増加によるものです。

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	2023年度第3四半期		2023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	2,519,163		2,517,145	
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	1,502,163	132,628	1,487,436	131,373
3 うち、安定預金の額	252,398	7,571	249,230	7,476
4 うち、準安定預金の額	1,249,765	125,056	1,238,206	123,896
5 ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	2,044,346	1,813,655	2,028,970	1,684,793
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	1,978,291	1,747,600	1,978,919	1,634,742
8 うち、負債性有価証券の額	66,054	66,054	50,050	50,050
9 有担保資金調達等に係る資金流出額	/	—	/	—
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	654,518	111,947	385,842	89,401
11 うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	19,030	19,030	18,881	18,881
12 うち、資金調達プログラムに係る資金流出額	—	—	—	—
13 うち、与信・流動性ファシリティに係る資金流出額	635,487	92,917	366,961	70,519
14 資金提供義務に基づく資金流出額等	5,653	5,637	6,841	6,127
15 偶発事象に係る資金流出額	1,030,040	1,542	1,031,908	1,538
16 資金流出合計額	/	2,065,412	/	1,913,234
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	26,063	—	6,599	—
18 貸付金等の回収に係る資金流入額	220,633	159,118	254,941	176,308
19 その他資金流入額	12,469	2,101	9,098	2,175
20 資金流入合計額	259,166	161,220	270,639	178,484
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	/ 2,519,163		/ 2,517,145	
22 純資金流出額	/ 1,904,192		/ 1,734,750	
23 連結流動性カバレッジ比率	/ 132.7%		/ 148.3%	
24 平均値計算用データ数	62		58	

(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、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		2023年度第3四半期					2023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	
利用可能安定調達額 (1)											
1	資本の額	606,102	—	—	—	606,102	610,799	—	—	—	610,799
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	606,102	—	—	—	606,102	610,799	—	—	—	610,799
3	うち、上記に含まれない資本調達手段及び資本の額	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
4	個人及び中小企業等からの資金調達	1,491,879	—	—	—	1,355,271	1,468,257	—	—	—	1,333,738
5	うち、安定預金等の額	251,591	—	—	—	239,011	246,148	—	—	—	233,840
6	うち、準安定預金等の額	1,240,288	—	—	—	1,116,259	1,222,109	—	—	—	1,099,898
7	ホールセール資金調達	642,236	2,518,157	339,230	595,861	1,454,617	628,741	1,637,296	135,886	583,353	1,452,512
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	642,236	2,518,157	339,230	595,861	1,454,617	628,741	1,637,296	135,886	583,353	1,452,512
10	相互に関係する資産がある負債	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
11	その他の負債	80,234	—	—	—	22,476	97,891	—	—	—	26,782
12	うち、デリバティブ負債の額	/	/	/	—	/	/	/	/	—	/
13	うち、上記に含まれない負債の額	80,234	—	—	—	22,476	97,891	—	—	—	26,782
14	利用可能安定調達額合計	/	/	/	/	3,438,467	/	/	/	/	3,423,833
所要安定調達額 (2)											
15	流動資産の額	/	/	/	/	69,022	/	/	/	/	75,196
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	5,766	—	—	—	2,883	5,271	—	—	—	2,635
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	315,413	551,628	231,005	2,292,613	2,359,361	327,399	439,304	266,859	2,301,539	2,332,550
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	—	20,145	—	—	—	—	20,066	—	—	—
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	274,061	129,590	47,481	292,350	376,638	293,356	110,804	53,156	303,196	390,398
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。)	283	365,714	172,342	1,919,507	1,858,972	279	262,369	212,615	1,918,208	1,825,123
21	うち、リスク・ウェイトが35%以下の資産の額	—	25,173	25,640	213,499	164,181	—	—	—	—	—
22	うち、住宅ローン債権	—	976	962	18,671	13,359	—	884	866	16,804	11,798
23	うち、リスク・ウェイトが35%以下の資産の額	—	898	883	17,404	12,204	—	884	866	16,804	11,798
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	41,068	35,202	10,218	62,083	110,390	33,763	45,178	221	63,330	105,229
25	相互に関係する負債がある資産	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
26	その他の資産等	449,448	1,727	674	31,005	480,359	474,046	5,545	1,321	34,680	513,117
27	うち、現物決済されるコモディティ(金を含む。)	—	/	/	/	—	—	/	/	/	—
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。)	/	/	/	16,500	14,025	/	/	/	16,500	14,025
29	うち、デリバティブ資産の額	/	/	/	359	359	/	/	/	—	—
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	/	/	/	—	—	/	/	/	—	—
31	うち、上記に含まれない資産及び資本の額	449,448	1,727	674	14,145	465,975	474,046	5,545	1,321	18,180	499,092
32	オフ・バランス取引	/	/	/	1,385,122	19,704	/	/	/	1,319,296	19,518
33	所要安定調達額合計	/	/	/	/	2,931,331	/	/	/	/	2,943,018
34	連結安定調達比率	/	/	/	/	117.3%	/	/	/	/	116.3%

(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又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

314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、314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又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又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、又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	固定報酬	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)	119	—
3		うち、現金報酬額	99	—
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	20	—
6		5のうち、繰延額	20	—
7		うち、その他報酬額	—	—
8		7のうち、繰延額	—	—
9	変動報酬	対象役員及び対象従業員等の数	4	—
10		変動報酬の総額(11+13+15)	56	—
11		うち、現金報酬額	28	—
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	27	—
14		13のうち、繰延額	27	—
15	うち、その他報酬額	—	—	
16	15のうち、繰延額	—	—	
17	退職慰労金	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	その他の報酬	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)		176	—

注) 1. 記載人数は、当事業年度に係る報酬等(2023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2022年度に係る報酬等(2022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、2023年度分及び2022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、2023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2022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、2024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2022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(2,229,193円/株)を乗じた額を含め記載しています。なお、これらは、2024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変動報酬(短期インセンティブ報酬及び株式報酬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まれていませんが、会計上は、所要の引当金を計上しています。

(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	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	—	—	0
	株式報酬額又は株式連動型報酬額	55	55	—	49	22
	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		55	55	—	49	22

(D) 当行の「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、単体流動性カバレッジ比率（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
		2023年度 第4四半期末	2023年度 第3四半期末	2023年度 第2四半期末	2023年度 第1四半期末	2022年度 第4四半期末
資本						
1	普通株式等Tier1資本の額	446,717	456,394	447,032	439,663	425,277
2	Tier1資本の額	446,717	456,394	447,032	439,663	425,277
3	総自己資本の額	446,816	456,502	447,171	439,793	425,443
リスク・アセット						
4	リスク・アセットの額	1,561,787	1,610,706	1,639,465	1,640,083	1,693,913
4a	リスク・アセットの額(フロア調整前)	1,561,787	/	/	/	/
	リスク・アセットの額(フロア調整最終実施ベース)	2,017,352	/	/	/	/
自己資本比率						
5	普通株式等Tier1比率	28.60%	28.33%	27.26%	26.80%	25.10%
5a	普通株式等Tier1比率(フロア調整前)	28.60%	/	/	/	/
	普通株式等Tier1比率(フロア調整最終実施ベース)	22.14%	/	/	/	/
6	Tier1比率	28.60%	28.33%	27.26%	26.80%	25.10%
6a	Tier1比率(フロア調整前)	28.60%	/	/	/	/
	Tier1比率(フロア調整最終実施ベース)	22.14%	/	/	/	/
7	総自己資本比率	28.60%	28.34%	27.27%	26.81%	25.11%
7a	総自己資本比率(フロア調整前)	28.60%	/	/	/	/
	総自己資本比率(フロア調整最終実施ベース)	22.14%	/	/	/	/
単体レバレッジ比率						
13	総エクスポージャーの額	3,949,597	3,979,977	3,968,132	4,264,391	4,073,301
14	単体レバレッジ比率	11.31%	11.46%	11.26%	10.31%	10.44%
単体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	2,435,144	2,436,855	2,591,104	2,835,989	2,629,418
16	純資金流出額	1,636,563	1,802,335	1,793,613	1,758,834	2,020,301
17	単体流動性カバレッジ比率	153.0%	135.8%	145.3%	162.2%	130.3%
単体安定調達比率						
18	利用可能安定調達額	3,349,816	3,373,322	3,445,147	3,598,870	3,473,103
19	所要安定調達額	2,866,019	2,869,520	2,928,385	3,093,557	3,006,771
20	単体安定調達比率	116.8%	117.5%	117.6%	116.3%	115.5%

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 2022年度	ロ 2023年度	ハ 別紙様式第十三号 (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	427,211	429,588	
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	275,474	273,744	
1c	うち自己株式の額(△)	79,999	79,999	
26	うち社外流出予定額(△)	31,137	27,030	
	うち上記以外に該当するものの額	—	—	
1b	普通株式に係る株式引受権及び新株予約権の合計額	—	—	
3	評価・換算差額等及びその他公表準備金の額	66,503	95,825	(a)
6	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	(イ) 493,715	525,414	
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	13,202	13,982	
8	うちのれんに係るものの額	227	184	
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	12,975	13,798	
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	4,642	6,624	
12	適格引当金不足額	1,292	4,136	
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	49,300	53,952	
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) 68,437	78,696	
普通株式等Tier1資本				
29	普通株式等Tier1資本の額((イ)-(ロ))	(ハ) 425,277	446,717	

(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 2022年度	ロ 2023年度	ハ 別紙様式第十三号 (CC2)の参照項目
その他Tier1資本に係る基礎項目		(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株式引受権及び新株予約権の合計額		—	—	
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		—	—	
36	その他Tier1資本に係る基礎項目の額	(二)	—	—	
その他Tier1資本に係る調整項目					
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)	—	—	
その他Tier1資本					
44	その他Tier1資本の額((二)-(ホ))	(ヘ)	—	—	
Tier1資本					
45	Tier1資本の額((ハ)+(ヘ))	(ト)	425,277	446,717	
Tier2資本に係る基礎項目		(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株式引受権及び新株予約権の合計額		—	—	
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		—	—	
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		166	98	
50a	うち一般貸倒引当金Tier2算入額		166	98	
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)	166	98	

(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 2022年度	ロ 2023年度	ハ 別紙様式第十三号 (CC2)の参照項目
Tier2資本に係る調整項目		(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)	—	—	
Tier2資本					
58	Tier2資本の額((チ)-(リ))	(ヌ)	166	98	
総自己資本					
59	総自己資本の額((ト)+(ヌ))	(ル)	425,443	446,816	
リスク・アセット		(6)			
60	リスク・アセットの額	(ヲ)	1,693,913	1,561,787	
自己資本比率		(7)			
61	普通株式等Tier1比率((ハ)/(ヲ))		25.10%	28.60%	
62	Tier1比率((ト)/(ヲ))		25.10%	28.60%	
63	総自己資本比率((ル)/(ヲ))		25.11%	28.60%	
調整項目に係る参考事項		(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		8,028	11,622	
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		812	3,088	
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		4,956	—	
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		(9)			
76	一般貸倒引当金の額		166	98	
77	一般貸倒引当金に係るTier2資本算入上限額		864	519	
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		8,112	7,479	

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 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	イ	ロ	ハ	ニ
	公表 貸借対照表 2022年度	公表 貸借対照表 2023年度	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
(資産の部)				
現金預け金	2,704,297	1,152,249		
債券貸借取引支払保証金	20,177	20,066		
買入金銭債権	32,261	23,296		
金銭の信託	27,418	30,298		
有価証券	265,136	293,598		6-b
貸出金	3,065,766	2,868,263		6-c
外国為替	5,160	6,220		
その他資産	277,573	347,463		6-d
有形固定資産	93,577	91,939		
無形固定資産	18,929	20,072		2
前払年金費用	71,058	77,763		3
支払承諾見返	13,655	14,142		
貸倒引当金	△3,601	△5,151		
資産の部合計	6,591,410	4,940,223		
(負債の部)				
預金	2,780,028	2,630,180		
譲渡性預金	470,180	264,030		
コールマネー	907,935	8,046		
借入金	303,400	409,200		7-a
信託勘定借	1,534,097	983,877		
その他負債	28,363	36,860		6-f
賞与引当金	3,134	5,205		
変動報酬引当金	245	271		
退職給付引当金	2,273	—		
偶発損失引当金	—	50		
睡眠預金払戻損失引当金	714	506		
繰延税金負債	22,527	35,407		4-b
支払承諾	13,655	14,142		
負債の部合計	6,066,558	4,387,778		
(純資産の部)				
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	275,474	273,744		1-c
自己株式	△79,999	△79,999		1-d
株主資本合計	458,349	456,619		
その他有価証券評価差額金	61,861	89,200		
繰延ヘッジ損益	4,642	6,624		5
評価・換算差額等合計	66,503	95,825	(a)	
純資産の部合計	524,852	552,444		
負債及び純資産の部合計	6,591,410	4,940,223		

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	2022年度	2023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	275,474	273,744	
1-d	自己株式	△79,999	△79,999	
	株主資本合計	458,349	456,619	

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	2022年度	2023年度	備考
	普通株式等Tier1資本に係る額	458,349	456,619	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	275,474	273,744	
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	2022年度	2023年度	備考
2	無形固定資産	18,929	20,072	
	上記に係る税効果	△5,726	△6,089	

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	2022年度	2023年度	備考
8	無形固定資産 のれんに係るもの	227	184	
9	無形固定資産 その他の無形固定資産	12,975	13,798	のれん、モーゲージ・サービシング・ライツ以外(ソフトウェア等)
	無形固定資産 モーゲージ・サービシング・ライツ	—	—	
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・ライツに係るものに限る。)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	2022年度	2023年度	備考
3	前払年金費用	71,058	77,763	
	上記に係る税効果	△21,758	△23,811	

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	2022年度	2023年度	備考
15	前払年金費用の額	49,300	53,952	

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	2022年度	2023年度	備考
	繰延税金資産	—	—	
4-b	繰延税金負債	22,527	35,407	
	無形固定資産の税効果勘案分	5,726	6,089	
	前払年金費用の税効果勘案分	21,758	23,811	

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	2022年度	2023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	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	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	2022年度	2023年度	備考
5	繰延ヘッジ損益	4,642	6,624	

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	2022年度	2023年度	備考
11	繰延ヘッジ損益の額	4,642	6,624	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	2022年度	2023年度	備考
	特定取引資産	—	—	
6-b	有価証券	265,136	293,598	
6-c	貸出金	3,065,766	2,868,263	
6-d	その他資産	277,573	347,463	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	28,363	36,860	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	2022年度	2023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	8,028	11,622	
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	8,028	11,622	
	その他金融機関等(10%超出資)	812	3,088	
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	812	3,088	

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	2022年度	2023年度	備考
7-a	借入金	303,400	409,200	
	社債	—	—	
	合計	303,400	409,200	

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	2022年度	2023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
		リスク・アセット 2022年度	所要自己資本 2022年度
1	信用リスク	1,150,060	96,717
2	うち、標準的手法適用分	—	—
3	うち、内部格付手法適用分	981,869	83,262
	うち、重要な出資のエクスポージャー	—	—
	うち、リース取引における見積残存価額のエクスポージャー	—	—
	その他	168,190	13,455
4	カウンターパーティ信用リスク	3,558	297
5	うち、SA-CCR適用分	—	—
	うち、カレント・エクスポージャー方式適用分	1	0
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	—	—
	うち、CVAリスク	—	—
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	899	71
	その他	2,657	225
7	マーケット・ベース方式に基づく株式等エクスポージャー	144,759	12,275
8	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算(ルック・スルー方式)	39,141	3,268
9	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算(マンドート方式)	—	—
	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%)	—	—
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	0
11	未決済取引	—	—
12	信用リスク・アセットの額の算出対象となっている証券化エクスポージャー	602	48
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	602	48
14	うち、外部格付準拠方式適用分	—	—
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	—	—
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	—	—
16	マーケット・リスク	47	3
17	うち、標準的方式適用分	47	3
18	うち、内部モデル方式適用分	—	—
19	オペレーショナル・リスク	271,713	21,737
20	うち、基礎的手法適用分	—	—
21	うち、粗利益配分手法適用分	—	—
22	うち、先進的計測手法適用分	271,713	21,737
23	特定項目のうち、調整項目に算入されない部分に係るエクスポージャー	14,423	1,163
	経過措置によりリスク・アセットの額に算入されるものの額	—	—
24	フロア調整	—	—
25	合計(スケーリング・ファクター勘案後)	1,693,913	135,513

(単位：百万円)

国際様式の 概要番号		イ		ロ	
		リスク・アセット		所要自己資本	
		2023年度		2023年度	
1	信用リスク	1,185,502	94,840		
2	うち、標準的手法適用分	164,179	13,134		
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	495,044	39,603		
4	うち、スロットティング・クライテリア適用分	—	—		
5	うち、先進的内部格付手法適用分	387,239	30,979		
	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	139,038	11,123		
6	カウンターパーティ信用リスク	4,019	321		
7	うち、SA-CCR適用分	—	—		
8	うち、期待エクスポージャー方式適用分	—	—		
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	571	45		
9	その他	3,448	275		
10	CVAリスク	—	—		
	うち、SA-CVA適用分	—	—		
	うち、完全なBA-CVA適用分	—	—		
	うち、限定的なBA-CVA適用分	—	—		
11	経過措置により適用されるマーケット・ベース方式に基づく株式等エクスポージャー	150,041	12,003		
12	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算（ルック・スルー方式）	34,816	2,785		
13	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算（マンドート方式）	—	—		
	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%）	—	—		
14	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算（フォールバック方式1250%）	740	59		
15	未決済取引	—	—		
16	信用リスク・アセットの額の算出対象となっている証券化エクスポージャー	3,308	264		
17	うち、内部格付手法準拠方式適用分	3,308	264		
18	うち、外部格付準拠方式又は内部評価方式適用分	—	—		
19	うち、標準的手法準拠方式適用分	—	—		
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	—	—		
20	マーケット・リスク	22,038	1,763		
21	うち、標準的方式適用分	—	—		
22	うち、内部モデル方式適用分	—	—		
	うち、簡易的方式適用分	22,038	1,763		
23	勘定間の振替分	—	—		
24	オペレーショナル・リスク	153,597	12,287		
25	特定項目のうち、調整項目に算入されない部分に係るエクスポージャー	7,722	617		
26	フロア調整	—	—		
27	合計	1,561,787	124,942		

注) 株式等エクスポージャーにおいて、内部格付手法で計測される場合に適用されるリスク・ウェイトと、標準的手法で計測される場合に適用されるリスク・ウェイトが同値の場合については、標準的手法を適用しているものとみなします。

みずほ信託銀行単体の自己資本の充実の状況

■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			
		2023年度		2022年度		2023年度		2022年度	
1	上方パラレルシフト	7,831	1,519			△15,996	△23,291		
2	下方パラレルシフト	0	2,130			15,136	23,433		
3	スティープ化	4,185	0			/	/		
4	フラット化	0	83			/	/		
5	短期金利上昇	1,395	245			/	/		
6	短期金利低下	0	391			/	/		
7	最大値	7,831	2,130			15,136	23,433		
		ホ				へ			
		2023年度		2022年度		2023年度		2022年度	
8	Tier1資本の額			446,717				425,277	

- 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うえ、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。

■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	2022年度
1. オン・バランス資産の額			
1		調整項目控除前のオン・バランス資産の額	3,843,976
1a	1	貸借対照表における総資産の額	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(△)	58,336
2	7	Tier1資本に係る調整項目の額(△)	63,795
3		オン・バランス資産の額 (イ)	3,780,180
2. デリバティブ取引等に関する額			
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	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	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	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)	31,610
3. レポ取引等に関する額			
12		レポ取引等に関する資産の額	20,177
13		レポ取引等に関する資産の額から控除した額(△)	—
14		レポ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	20,177
15		代理取引のエクスポージャーの額	/
16	5	レポ取引等に関する額 (ハ)	40,355
4. オフ・バランス取引に関する額			
17		オフ・バランス取引の想定元本の額	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(△)	263,861
19	6	オフ・バランス取引に関する額 (ニ)	221,155
5. 単体レバレッジ比率			
20		資本の額 (ホ)	425,277
21	8	総エクスポージャーの額((イ)+(ロ)+(ハ)+(ニ)) (ヘ)	4,073,301
22		単体レバレッジ比率(ホ)/(ヘ)	10.44%
		適用する所要単体レバレッジ比率	3.00%
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			
		総エクスポージャーの額 (ヘ)	4,073,301
		日本銀行に対する預け金の額	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')	6,762,398
		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')	6.28%

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自己資本の充実の状況

(単位：百万円)

項番(国際様式(LR1)の該当番号)	項目	2023年度
1	貸借対照表における総資産の額	4,940,223
3	リスク移転の認識に係る要件を充足しない証券化エクスポージャーに係る調整	—
4	中央銀行預け金に係る除外による調整(△)	1,133,176
5	顧客資産のうち、貸借対照表に計上されている金額(△)	/
6	有価証券の売買を約定日基準により会計処理している場合における調整項目	—
7	キャッシュ・プーリング契約に基づく資金の移動に係る調整項目	—
8	デリバティブ取引等に関する調整額	△20,729
8a	デリバティブ取引等に関する額	5,480
8b	デリバティブ取引等に関連する資産の額(△)	26,209
9	レポ取引等に関する調整額	20,066
9a	レポ取引等に関する額	40,133
9b	レポ取引等に関する額(△)	20,066
10	オフ・バランス取引に関する額	229,427
11	Tier1資本に係る調整項目の額(貸倒引当金)(△)	4,136
12	その他の調整項目	△82,077
12a	Tier1資本に係る調整項目の額(貸倒引当金以外)(△)	67,935
12b	支払承諾見返動定の額(△)	14,142
12c	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(相殺した額に相当する部分に限る。)	—
12d	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(△)	—
13	総エクスポージャーの額	3,949,597

(単位：百万円、%)

項番(国際様式(LR2)の該当番号)	項目	2023年度
オン・バランス資産の額 (1)		
1	個別項目調整前のオン・バランス資産の額	3,746,627
2	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(相殺した額に相当する部分に限る。)	—
3	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(△)	—
4	レポ取引等により受領した証券の計上額(△)	—
5	Tier1資本に係る調整項目の額(貸倒引当金)(△)	4,136
6	Tier1資本に係る調整項目の額(貸倒引当金以外)(△)	67,935
7	オン・バランス資産の額 (イ)	3,674,556
デリバティブ取引等に関する額 (2)		
8	デリバティブ取引等に関するRCの額に1.4を乗じた額	—
9	デリバティブ取引等に関するPFEの額に1.4を乗じた額	5,480
10	間接清算参加者に適格中央清算機関の債務履行を保証していない場合に零とした中央清算機関向けエクスポージャーの額(△)	—
11	クレジット・デリバティブ等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	—
12	クレジット・デリバティブ等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(△)	—
13	デリバティブ取引等に関する額 (ロ)	5,480
レポ取引等に関する額 (3)		
14	レポ取引等に関する資産の額	20,066
15	レポ取引等に関する資産の額から控除した額(△)	—
16	レポ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	20,066
17	代理取引のエクスポージャーの額	/
18	レポ取引等に関する額 (ハ)	40,133
オフ・バランス取引に関する額 (4)		
19	オフ・バランス取引の想定元本の額	670,134
20	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(△)	440,706
22	オフ・バランス取引に関する額 (ニ)	229,427
単体レバレッジ比率 (5)		
23	資本の額 (ホ)	446,717
24	総エクスポージャーの額((イ)+(ロ)+(ハ)+(ニ)) (ヘ)	3,949,597
25	単体レバレッジ比率((ホ)/(ヘ))	11.31%
26	適用する所要単体レバレッジ比率	3.00%
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 (6)		
	総エクスポージャーの額 (ヘ)	3,949,597
	日本銀行に対する預け金の額	1,133,176
	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')	5,082,774
	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'))	8.78%
平均値の開示 (7)		
28	レポ取引等に関する資産の額(控除後)に係る平均値((ト)+(チ))	28,381
	レポ取引等に関する資産の額に係る平均値 (ト)	28,381
	レポ取引等に関する資産の額から控除した額に係る平均値(△) (チ)	—
29	レポ取引等に関する資産の額(控除後)に係る四半期末の値((リ)+(ヌ))	20,066
14	レポ取引等に関する資産の額に係る四半期末の値 (リ)	20,066
15	レポ取引等に関する資産の額から控除した額に係る四半期末の値(△) (ヌ)	—
30	総エクスポージャーの額(レポ取引等に関する資産の額(控除後)に係る平均値を使用し、日本銀行に対する預け金を算入しない場合) (ル)	3,957,912
30a	総エクスポージャーの額(レポ取引等に関する資産の額(控除後)に係る平均値を使用し、日本銀行に対する預け金を算入する場合) (ヲ)	5,091,088
31	単体レバレッジ比率(レポ取引等に関する資産の額(控除後)に係る平均値を使用し、日本銀行に対する預け金を算入しない場合)((ホ)/(ル))	11.28%
31a	単体レバレッジ比率(レポ取引等に関する資産の額(控除後)に係る平均値を使用し、日本銀行に対する預け金を算入する場合)((ホ)/(ヲ))	8.77%

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自己資本の充実の状況

(2) 前会計年度の単体レバレッジ比率との間に著しい差異を生じた原因

普通株式等Tier1資本の増加によるものです。

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	2023年度第3四半期		2023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	2,436,855		2,435,144	
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	1,502,163	132,628	1,487,436	131,373
3 うち、安定預金の額	252,398	7,571	249,230	7,476
4 うち、準安定預金の額	1,249,765	125,056	1,238,206	123,896
5 ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,920,804	1,690,113	1,912,717	1,568,541
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	1,854,749	1,624,058	1,862,667	1,518,490
8 うち、負債性有価証券の額	66,054	66,054	50,050	50,050
9 有担保資金調達等に係る資金流出額	/	—	/	—
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	654,517	111,946	385,842	89,401
11 うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	19,029	19,029	18,881	18,881
12 うち、資金調達プログラムに係る資金流出額	—	—	—	—
13 うち、与信・流動性ファシリティに係る資金流出額	635,487	92,917	366,961	70,519
14 資金提供義務に基づく資金流出額等	696	680	2,376	1,662
15 偶発事象に係る資金流出額	1,031,240	1,578	1,033,108	1,574
16 資金流出合計額	/	1,936,948	/	1,792,552
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	26,063	—	6,599	—
18 貸付金等の回収に係る資金流入額	189,658	128,143	225,355	146,722
19 その他資金流入額	6,574	6,469	9,406	9,266
20 資金流入合計額	222,296	134,612	241,360	155,989
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	/	2,436,855	/	2,435,144
22 純資金流出額	/	1,802,335	/	1,636,563
23 単体流動性カバレッジ比率	/	135.8%	/	153.0%
24 平均値計算用データ数	62		58	

(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、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		2023年度第3四半期					2023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	
利用可能安定調達額 (1)											
1	資本の額	531,825	—	—	—	531,825	525,497	—	—	—	525,497
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	531,825	—	—	—	531,825	525,497	—	—	—	525,497
3	うち、上記に含まれない資本調達手段及び資本の額	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
4	個人及び中小企業等からの資金調達	1,491,879	—	—	—	1,355,271	1,468,257	—	—	—	1,333,738
5	うち、安定預金等の額	251,591	—	—	—	239,011	246,148	—	—	—	233,840
6	うち、準安定預金等の額	1,240,288	—	—	—	1,116,259	1,222,109	—	—	—	1,099,898
7	ホールセール資金調達	509,599	2,518,157	339,230	595,861	1,463,748	518,407	1,636,480	135,886	583,353	1,463,797
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	509,599	2,518,157	339,230	595,861	1,463,748	518,407	1,636,480	135,886	583,353	1,463,797
10	相互に関係する資産がある負債	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
11	その他の負債	56,812	—	—	—	22,476	68,127	—	—	—	26,782
12	うち、デリバティブ負債の額	/	/	/	—	/	/	/	/	—	/
13	うち、上記に含まれない負債の額	56,812	—	—	—	22,476	68,127	—	—	—	26,782
14	利用可能安定調達額合計	/	/	/	/	3,373,322	/	/	/	/	3,349,816
所要安定調達額 (2)											
15	流動資産の額	/	/	/	/	69,022	/	/	/	/	75,196
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	6,723	—	—	—	3,361	6,220	—	—	—	3,110
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	217,314	524,369	231,005	2,303,613	2,351,555	247,149	415,243	266,859	2,312,539	2,329,981
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	—	20,145	—	—	—	—	20,066	—	—	—
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	175,964	102,330	47,481	303,350	368,835	210,139	86,744	53,156	314,196	385,306
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。）	283	365,714	172,342	1,919,507	1,858,972	279	262,369	212,615	1,918,208	1,825,123
21	うち、リスク・ウェイトが35%以下の資産の額	—	25,173	25,640	213,499	164,181	—	—	—	—	—
22	うち、住宅ローン債権	—	976	962	18,671	13,359	—	884	866	16,804	11,798
23	うち、リスク・ウェイトが35%以下の資産の額	—	898	883	17,404	12,204	—	884	866	16,804	11,798
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	41,066	35,202	10,218	62,083	110,388	36,730	45,178	221	63,330	107,751
25	相互に関係する負債がある資産	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
26	その他の資産等	394,928	1,727	674	31,005	425,839	399,105	5,545	1,321	34,680	438,176
27	うち、現物決済されるコモディティ（金を含む。）	—	/	/	/	—	—	/	/	/	—
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。）	/	/	/	16,500	14,025	/	/	/	16,500	14,025
29	うち、デリバティブ資産の額	/	/	/	359	359	/	/	/	—	—
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	/	/	/	—	—	/	/	/	—	—
31	うち、上記に含まれない資産及び資本の額	394,928	1,727	674	14,145	411,455	399,105	5,545	1,321	18,180	424,151
32	オフ・バランス取引	/	/	/	1,386,322	19,740	/	/	/	1,320,496	19,554
33	所要安定調達額合計	/	/	/	/	2,869,520	/	/	/	/	2,866,019
34	単体安定調達比率	/	/	/	/	117.5%	/	/	/	/	116.8%

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

(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「当行の業務の運営又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、314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)「当行の業務の運営又は財産の状況に重要な影響を与える者」の範囲

「当行の業務の運営又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、又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	固定報酬	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)	119	—
3		うち、現金報酬額	99	—
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	20	—
6		5のうち、繰延額	20	—
7		うち、その他報酬額	—	—
8		7のうち、繰延額	—	—
9	変動報酬	対象役員及び対象従業員等の数	4	—
10		変動報酬の総額(11+13+15)	56	—
11		うち、現金報酬額	28	—
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	27	—
14		13のうち、繰延額	27	—
15	うち、その他報酬額	—	—	
16	15のうち、繰延額	—	—	
17	退職慰労金	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	その他の報酬	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)		176	—

注) 1. 記載人数は、当事業年度に係る報酬等(2023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2022年度に係る報酬等(2022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、2023年度分及び2022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、2023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2022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、2024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2022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(2,229.193円/株)を乗じた額を含め記載しています。なお、これらは、2024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変動報酬(短期インセンティブ報酬及び株式報酬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	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	—	—	0
	株式報酬額又は株式連動型報酬額	55	55	—	49	22
	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		55	55	—	49	22

(D) 当行の「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。