

自己資本比率の算式における分母の額に関する開示事項

みずほ銀行【連結】
2021年9月末

(単位：百万円)

0V1: リスク・アセットの概要		イ	ロ	ハ	ニ
国際様式の 該当番号		リスク・アセット		所要自己資本	
		2021年9月末	2021年6月末	2021年9月末	2021年6月末
1	信用リスク	40,144,419	39,957,024	3,389,815	3,373,483
2	うち、標準的手法適用分	1,697,545	1,690,009	135,803	135,200
3	うち、内部格付手法適用分	37,137,943	36,858,635	3,149,297	3,125,612
	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	1,308,930	1,408,380	104,714	112,670
4	カウンターパーティ信用リスク	3,561,470	3,466,296	290,997	283,453
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	160,765	138,425	13,500	11,631
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	1,101,080	1,040,306	92,908	88,105
	うち、CVAリスク	1,699,769	1,721,682	135,981	137,734
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	140,972	138,828	11,277	11,106
	その他	458,882	427,053	37,329	34,876
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	3,799,062	3,987,702	322,160	338,157
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）	5,483,690	5,949,717	464,045	503,533
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%）	119,296	183,042	10,116	15,522
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%）	254,620	220,574	20,379	17,646
11	未決済取引	19,386	2,548	1,643	215
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	1,018,128	1,045,265	81,450	83,621
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	862,531	876,679	69,002	70,134
14	うち、外部格付準拠方式適用分	155,345	168,352	12,427	13,468
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	251	233	20	18
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	0	0	0	0
16	マーケット・リスク	1,458,289	1,448,932	116,663	115,914
17	うち、標準的方式適用分	610,946	686,364	48,875	54,909
18	うち、内部モデル方式適用分	847,342	762,567	67,787	61,005
19	オペレーショナル・リスク	2,270,139	2,262,845	181,611	181,027
20	うち、基礎的手法適用分	540,381	527,479	43,230	42,198
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	1,729,757	1,735,365	138,380	138,829
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	1,064,788	1,079,994	88,481	89,637
	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(スケールリング・ファクター勘案後)	62,092,068	62,527,663	4,967,365	5,002,213

(単位：億円)

CR8：内部格付手法を適用した信用リスク・エクスポージャーのリスク・アセット変動表			
項番		信用リスク・アセットの額	
1	前四半期末時点における信用リスク・アセットの額	428,906	
2	当四半期中の要因別の変動額	資産の規模	1,007
3		ポートフォリオの質	△ 1,272
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	690
8		その他	△ 167
9	当四半期末時点における信用リスク・アセットの額	429,164	

- 注) 1. カウンターパーティ信用リスク、証券化エクスポージャー、信用リスク・アセットのみなし計算が適用されるエクスポージャーを除いています。
2. 資産の規模は、会計上の資産の増減、新規事業の取組による資産の増加及び債権の満期到来による資産の減少等に起因するリスク・アセットの変動額です。
3. ポートフォリオの質は、債務者及び案件の格付区分の遷移、担保価値及び保証の変動等に起因するリスク・アセットの変動額です。
4. 手法及び方針は、当局による規制の変更による計算手法の変更に起因するリスク・アセットの変動額です。
5. 為替の変動は、外貨建取引のエクスポージャーが為替変動の影響を受けることに起因するリスク・アセットの変動額です。

みずほ銀行【連結】
2021年9月末

(単位：億円)

GCR7：期待エクスポージャー方式を用いたカウンターパーティ信用リスク・エクスポージャーのリスク・アセット変動表			
項番		信用リスク・アセットの額	
1	前四半期末時点における信用リスク・アセットの額	10,403	
2	当四半期中の要因別の変動額	資産の規模	611
3		取引相手方の信用力	△ 44
4		モデルの更新（期待エクスポージャー方式に係る変動のみ）	-
5		手法及び方針（期待エクスポージャー方式に係る変動のみ）	-
6		買収又は売却	-
7		為替の変動	40
8		その他	0
9	当四半期末時点における信用リスク・アセットの額	11,010	

みずほ銀行【連結】
2021年9月末

(単位：億円)

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								
項番		イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ	
		バリュー・アット・リスク	ストレス・バリュー・アット・リスク	追加的リスク	包括的リスク	その他	合計	
1a	前四半期末におけるリスク・アセット	2,572	5,052	-	-		7,625	
1b	前四半期末における自己資本比率規制上のリスク・アセット額への調整	3.20	2.89	-	-		2.99	
1c	前四半期末の算出基準日における内部モデル方式の算出額	802	1,746	-	-		2,548	
2	当四半期中の 要因別の変動額	リスク量の変動	374	637	-	-		1,012
3		モデルの更新又は変更	-	-	-	-		-
4		手法及び方針	-	-	-	-		-
5		買収及び売却	-	-	-	-		-
6		為替の変動	△ 91	△ 101	-	-		△ 192
7		その他	△ 63	90	-	-		26
8a	当四半期末の算出基準日における内部モデル方式の算出額	1,021	2,373	-	-		3,395	
8b	当四半期末における自己資本比率規制上のリスク・アセット額への調整	2.55	2.47	-	-		2.49	
8c	当四半期末におけるリスク・アセット	2,607	5,866	-	-		8,473	