

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12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12月末	2021年9月末	2021年12月末	2021年9月末
1	信用リスク	40,176,967	40,144,419	3,392,783	3,389,815
2	うち、標準的手法適用分	1,651,019	1,697,545	132,081	135,803
3	うち、内部格付手法適用分	37,213,692	37,137,943	3,155,721	3,149,297
	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	1,312,256	1,308,930	104,980	104,714
4	カウンターパーティ信用リスク	3,525,541	3,561,470	287,754	290,997
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	123,663	160,765	10,376	13,500
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	943,995	1,101,080	79,969	92,908
	うち、CVAリスク	1,841,195	1,699,769	147,295	135,981
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	102,718	140,972	8,217	11,277
	その他	513,967	458,882	41,895	37,329
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	3,218,514	3,799,062	272,930	322,160
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）	5,056,305	5,483,690	427,821	464,045
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%）	326,259	119,296	27,666	10,116
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%）	194,407	254,620	15,555	20,379
11	未決済取引	1,327	19,386	112	1,643
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	963,565	1,018,128	77,085	81,450
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	837,528	862,531	67,002	69,002
14	うち、外部格付準拠方式適用分	125,786	155,345	10,062	12,427
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	251	251	20	20
	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	1,495,496	1,458,289	119,639	116,663
17	うち、標準的方式適用分	440,545	610,946	35,243	48,875
18	うち、内部モデル方式適用分	1,054,950	847,342	84,396	67,787
19	オペレーショナル・リスク	2,268,799	2,270,139	181,503	181,611
20	うち、基礎的手法適用分	540,381	540,381	43,230	43,230
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	1,728,417	1,729,757	138,273	138,380
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	1,427,123	1,064,788	117,544	88,481
	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）	61,504,960	62,092,068	4,920,396	4,967,365

みずほ銀行【連結】
2021年12月末

(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	429,164	
2	当四半期中の要因別の変動額	資産の規模	△ 2,392
3		ポートフォリオの質	△ 3,258
4		モデルの更新	-
5		手法及び方針	-
6		買収又は売却	-
7		為替の変動	3,870
8		その他	405
9		当四半期末時点における信用リスク・アセットの額	427,789

- 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12月末

(単位：億円)

CCR7：期待エクスポージャー方式を用いたカウンターパーティ信用リスク・エクスポージャーのリスク・アセット変動表			
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	11,010	
2	当四半期中の要因別の変動額	資産の規模	△ 1,802
3		取引相手方の信用力	38
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	188
8		その他	4
9		当四半期末時点における信用リスク・アセットの額	9,439

みずほ銀行【連結】
2021年12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	
		バリュエーション・リスク	ストレステスト・バリュエーション・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	2,607	5,866	-	-		8,473	
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	2.55	2.47	-	-		2.49	
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	1,021	2,373	-	-		3,395	
2	当四半期中の 要因別の変動額	リスク量の変動	273	410	-	-		683
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	△ 319	373	-	-		53
7		その他	269	△ 313	-	-		△ 43
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	1,245	2,843	-	-		4,088	
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	2.75	2.50	-	-		2.58	
8c	当四半期末におけるリスク・アセット	3,435	7,113	-	-		10,549	