

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【単体】  
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	39,220,083	39,295,217	3,320,047	3,326,329
2	うち、標準的手法適用分	-	-	-	-
3	うち、内部格付手法適用分	38,008,476	38,065,114	3,223,118	3,227,921
	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	1,211,606	1,230,103	96,928	98,408
4	カウンターパーティ信用リスク	2,355,666	2,123,700	192,904	174,245
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	27,229	32,609	2,309	2,765
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	738,692	746,075	62,641	63,267
	うち、CVAリスク	1,362,765	1,152,129	109,021	92,170
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	65,470	65,379	5,237	5,230
	その他	161,507	127,506	13,695	10,812
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	2,890,923	3,473,820	245,150	294,579
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）	5,254,127	5,703,053	444,611	482,654
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%）	348,061	140,669	29,515	11,928
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%）	193,430	253,839	15,476	20,317
11	未決済取引	1,265	19,339	107	1,639
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	943,760	994,656	75,500	79,572
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	817,723	839,060	65,417	67,124
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	748,364	787,158	59,869	62,972
17	うち、標準的方式適用分	142,074	258,386	11,365	20,670
18	うち、内部モデル方式適用分	606,290	528,772	48,503	42,301
19	オペレーショナル・リスク	1,728,417	1,729,757	138,273	138,380
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	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	1,112,211	770,038	91,082	63,709
	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）	57,656,757	58,204,140	4,612,540	4,656,331