

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】
2022年3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	
		2022年3月末	2021年12月末	2022年3月末	2021年12月末
1	信用リスク	39,760,822	40,176,967	3,356,878	3,392,783
2	うち、標準的手法適用分	1,709,156	1,651,019	136,732	132,081
3	うち、内部格付手法適用分	36,669,381	37,213,692	3,109,563	3,155,721
	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	1,382,284	1,312,256	110,582	104,980
4	カウンターパーティ信用リスク	3,930,115	3,525,541	320,676	287,754
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	189,338	123,663	15,880	10,376
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	931,481	943,995	78,787	79,969
	うち、CVAリスク	1,986,367	1,841,195	158,909	147,295
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	130,573	102,718	10,445	8,217
	その他	692,354	513,967	56,652	41,895
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	2,307,781	3,218,514	195,699	272,930
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）	3,783,068	5,056,305	319,931	427,821
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%）	401,270	326,259	34,027	27,666
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%）	209,512	194,407	17,400	15,555
11	未決済取引	2,605	1,327	217	112
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	939,667	963,565	75,173	77,085
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	822,694	837,528	65,815	67,002
14	うち、外部格付準拠方式適用分	116,669	125,786	9,333	10,062
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	255	251	20	20
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	48	0	3	0
16	マーケット・リスク	1,626,359	1,495,496	130,108	119,639
17	うち、標準的方式適用分	415,215	440,545	33,217	35,243
18	うち、内部モデル方式適用分	1,211,143	1,054,950	96,891	84,396
19	オペレーショナル・リスク	2,269,822	2,268,799	181,585	181,503
20	うち、基礎的手法適用分	562,287	540,381	44,982	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	1,707,535	1,728,417	136,602	138,273
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	1,707,990	1,427,123	139,392	117,544
	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)	59,638,667	61,504,960	4,771,093	4,920,396

みずほ銀行【連結】
2022年3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	427,789	
2	当四半期中の要因別の変動額	資産の規模	△ 11,189
3		ポートフォリオの質	△ 10,832
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	9,475
8		その他	312
9		当四半期末時点における信用リスク・アセットの額	415,555

- 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】
2022年3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	9,439	
2	当四半期中の要因別の変動額	資産の規模	△ 393
3		取引相手方の信用力	△ 162
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	418
8		その他	11
9		当四半期末時点における信用リスク・アセットの額	9,314

みずほ銀行【連結】
2022年3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	へ
		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	3,435	7,113	-	-		10,549
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	2.75	2.50	-	-		2.58
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	1,245	2,843	-	-		4,088
2	当四半期中の要因別の変動額	リスク量の変動	△ 521	△ 1,082	-	-	△ 1,604
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	△ 348	△ 318	-	-	△ 667
7		その他	657	1,300	-	-	1,957
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	1,031	2,743	-	-		3,775
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	3.93	2.93	-	-		3.20
8c	当四半期末におけるリスク・アセット	4,060	8,051	-	-		12,111