

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6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6月末	2022年3月末	2022年6月末	2022年3月末
1	信用リスク	41,858,022	39,760,822	3,533,504	3,356,878
2	うち、標準的手法適用分	1,892,769	1,709,156	151,421	136,732
3	うち、内部格付手法適用分	38,512,981	36,669,381	3,265,900	3,109,563
	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	1,452,272	1,382,284	116,181	110,582
4	カウンターパーティ信用リスク	3,906,475	3,930,115	319,220	320,676
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	247,299	189,338	20,770	15,880
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	958,144	931,481	81,045	78,787
	うち、CVAリスク	1,809,876	1,986,367	144,790	158,909
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	241,897	130,573	19,351	10,445
	その他	649,256	692,354	53,262	56,652
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	3,241,029	2,307,781	274,839	195,699
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）	4,019,550	3,783,068	339,946	319,931
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%）	377,229	401,270	31,989	34,027
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%）	96,141	209,512	7,737	17,400
11	未決済取引	20,720	2,605	1,756	217
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	1,046,147	939,667	83,691	75,173
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	922,065	822,694	73,765	65,815
14	うち、外部格付準拠方式適用分	123,596	116,669	9,887	9,333
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	267	255	21	20
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	217	48	17	3
16	マーケット・リスク	1,728,964	1,626,359	138,317	130,108
17	うち、標準的方式適用分	425,784	415,215	34,062	33,217
18	うち、内部モデル方式適用分	1,303,180	1,211,143	104,254	96,891
19	オペレーショナル・リスク	2,269,208	2,269,822	181,536	181,585
20	うち、基礎的手法適用分	562,287	562,287	44,982	44,982
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	1,706,921	1,707,535	136,553	136,602
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	2,186,549	1,707,990	177,863	139,392
	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）	63,630,037	59,638,667	5,090,403	4,771,093

みずほ銀行【連結】
2022年6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	415,555	
2	当四半期中の要因別の変動額	資産の規模	19,319
3		ポートフォリオの質	△ 2,016
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	15,462
8		その他	△ 36
9		当四半期末時点における信用リスク・アセットの額	448,284

- 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6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	9,314	
2	当四半期中の要因別の変動額	資産の規模	△ 427
3		取引相手方の信用力	25
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	671
8		その他	△ 2
9		当四半期末時点における信用リスク・アセットの額	9,581

みずほ銀行【連結】
2022年6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	4,060	8,051	-	-		12,111	
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	3.93	2.93	-	-		3.20	
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	1,031	2,743	-	-		3,775	
2	当四半期中の 要因別の変動額	リスク量の変動	△ 1,496	△ 1,861	-	-		△ 3,358
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	△ 1,800	△ 1,868	-	-		△ 3,669
7		その他	4,040	4,070	-	-		8,110
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	1,774	3,083	-	-		4,858	
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	2.75	-	-		2.68	
8c	当四半期末におけるリスク・アセット	4,532	8,499	-	-		13,031	