

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	
		2022年9月末	2022年6月末	2022年9月末	2022年6月末
1	信用リスク	43,118,187	41,858,022	3,639,502	3,533,504
2	うち、標準的手法適用分	2,112,829	1,892,769	169,026	151,421
3	うち、内部格付手法適用分	39,593,210	38,512,981	3,357,504	3,265,900
	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	1,412,146	1,452,272	112,971	116,181
4	カウンターパーティ信用リスク	4,296,079	3,906,475	350,960	319,220
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	319,877	247,299	26,783	20,770
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	996,302	958,144	84,381	81,045
	うち、CVAリスク	1,907,786	1,809,876	152,622	144,790
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	282,708	241,897	22,616	19,351
	その他	789,403	649,256	64,556	53,262
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	3,554,944	3,241,029	301,459	274,839
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）	3,967,446	4,019,550	335,569	339,946
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%）	408,990	377,229	34,682	31,989
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%）	113,006	96,141	9,149	7,737
11	未決済取引	6,924	20,720	585	1,756
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	1,264,314	1,046,147	101,145	83,691
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	1,134,221	922,065	90,737	73,765
14	うち、外部格付準拠方式適用分	129,363	123,596	10,349	9,887
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	263	267	21	21
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	466	217	37	17
16	マーケット・リスク	1,880,051	1,728,964	150,404	138,317
17	うち、標準的方式適用分	467,204	425,784	37,376	34,062
18	うち、内部モデル方式適用分	1,412,847	1,303,180	113,027	104,254
19	オペレーショナル・リスク	2,307,480	2,269,208	184,598	181,536
20	うち、基礎的手法適用分	599,480	562,287	47,958	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	1,707,999	1,706,921	136,639	136,553
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	2,363,718	2,186,549	192,256	177,863
	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）	66,253,919	63,630,037	5,300,313	5,090,403

(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	448,284	
2	当四半期中の要因別の変動額	資産の規模	9,608
3		ポートフォリオの質	△ 972
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	7,558
8		その他	△ 486
9		当四半期末時点における信用リスク・アセットの額	463,992

- 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9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	9,581	
2	当四半期中の要因別の変動額	資産の規模	△ 4
3		取引相手方の信用力	62
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	326
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	9,963	

みずほ銀行【連結】
2022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 バリュー・ アット・ リスク	ロ ストレス・ バリュー・ アット・ リスク	ハ 追加的 リスク	ニ 包括的 リスク	ホ その他	へ 合計
1a	前四半期末におけるリスク・アセット	4,532	8,499	-	-		13,031
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	2.75	-	-		2.68
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	1,774	3,083	-	-		4,858
2	当四半期中の 要因別の変動額	リスク量の変動	△ 520	△ 494	-	-	△ 1,014
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	△ 750	△ 759	-	-	△ 1,509
7		その他	1,207	1,059	-	-	2,267
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	1,712	2,889	-	-		4,601
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	3.14	3.02	-	-		3.07
8c	当四半期末におけるリスク・アセット	5,392	8,736	-	-		14,128