

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	
		2022年12月末	2022年9月末	2022年12月末	2022年9月末
1	信用リスク	42,974,365	43,118,187	3,626,456	3,639,502
2	うち、標準的手法適用分	2,142,566	2,112,829	171,405	169,026
3	うち、内部格付手法適用分	39,272,302	39,593,210	3,330,291	3,357,504
	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	1,559,497	1,412,146	124,759	112,971
4	カウンターパーティ信用リスク	3,895,056	4,296,079	318,724	350,960
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	272,401	319,877	22,891	26,783
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	902,829	996,302	76,316	84,381
	うち、CVAリスク	1,532,208	1,907,786	122,576	152,622
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	272,802	282,708	21,824	22,616
	その他	914,814	789,403	75,115	64,556
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	3,668,790	3,554,944	311,113	301,459
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）	4,022,780	3,967,446	340,257	335,569
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%）	495,603	408,990	42,027	34,682
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%）	73,621	113,006	6,007	9,149
11	未決済取引	1,706	6,924	142	585
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	1,267,532	1,264,314	101,402	101,145
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	1,144,639	1,134,221	91,571	90,737
14	うち、外部格付準拠方式適用分	121,974	129,363	9,757	10,349
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	218	263	17	21
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	699	466	55	37
16	マーケット・リスク	1,985,634	1,880,051	158,850	150,404
17	うち、標準的方式適用分	372,411	467,204	29,792	37,376
18	うち、内部モデル方式適用分	1,613,222	1,412,847	129,057	113,027
19	オペレーショナル・リスク	2,303,124	2,307,480	184,249	184,598
20	うち、基礎的手法適用分	599,480	599,480	47,958	47,958
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	1,703,644	1,707,999	136,291	136,639
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	2,232,822	2,363,718	182,170	192,256
	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）	65,892,534	66,253,919	5,271,402	5,300,313

みずほ銀行【連結】
2022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	463,992	
2	当四半期中の要因別の変動額	資産の規模	7,017
3		ポートフォリオの質	2,608
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	△ 13,710
8		その他	713
9	当四半期末時点における信用リスク・アセットの額	460,621	

- 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等に起因するリスク・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	9,963	
2	当四半期中の要因別の変動額	資産の規模	△ 394
3		取引相手方の信用力	5
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	△ 547
8		その他	-
9	当四半期末時点における信用リスク・アセットの額	9,028	

みずほ銀行【連結】
2022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	5,392	8,736	-	-		14,128	
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	3.14	3.02	-	-		3.07	
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	1,712	2,889	-	-		4,601	
2	当四半期中の 要因別の変動額	リスク量の変動	△ 3,208	△ 1,401	-	-		△ 4,609
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	△ 1,456	△ 1,511	-	-		△ 2,967
7		その他	4,841	2,878	-	-		7,720
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	1,888	2,855	-	-		4,744	
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	3.53	3.31	-	-		3.40	
8c	当四半期末におけるリスク・アセット	6,680	9,452	-	-		16,132	