

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】
2023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	
		2023年3月末	2022年12月末	2023年3月末	2022年12月末
1	信用リスク	41,826,381	42,974,365	3,529,792	3,626,456
2	うち、標準的手法適用分	2,089,227	2,142,566	167,138	171,405
3	うち、内部格付手法適用分	38,267,153	39,272,302	3,245,054	3,330,291
	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	1,470,000	1,559,497	117,600	124,759
4	カウンターパーティ信用リスク	4,025,104	3,895,056	328,594	318,724
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	259,416	272,401	21,675	22,891
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	826,529	902,829	69,997	76,316
	うち、CVAリスク	1,683,177	1,532,208	134,654	122,576
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	255,595	272,802	20,447	21,824
	その他	1,000,385	914,814	81,820	75,115
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	3,671,636	3,668,790	311,354	311,113
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）	4,572,513	4,022,780	386,841	340,257
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%）	459,186	495,603	38,938	42,027
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%）	58,841	73,621	4,818	6,007
11	未決済取引	2,836	1,706	240	142
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	1,389,862	1,267,532	111,189	101,402
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	1,266,240	1,144,639	101,299	91,571
14	うち、外部格付準拠方式適用分	122,635	121,974	9,810	9,757
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	204	218	16	17
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	782	699	62	55
16	マーケット・リスク	2,060,322	1,985,634	164,825	158,850
17	うち、標準的方式適用分	485,467	372,411	38,837	29,792
18	うち、内部モデル方式適用分	1,574,855	1,613,222	125,988	129,057
19	オペレーショナル・リスク	2,327,173	2,303,124	186,173	184,249
20	うち、基礎的手法適用分	651,509	599,480	52,120	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	1,675,664	1,703,644	134,053	136,291
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	2,049,003	2,232,822	166,977	182,170
	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）	65,371,848	65,892,534	5,229,747	5,271,402

(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	460,621	
2	当四半期中の要因別の変動額	資産の規模	△ 8,712
3		ポートフォリオの質	△ 5,106
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	1,887
8		その他	47
9	当四半期末時点における信用リスク・アセットの額	448,737	

- 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】
2023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	9,028	
2	当四半期中の要因別の変動額	資産の規模	△ 549
3		取引相手方の信用力	△ 278
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	66
8		その他	△ 1
9	当四半期末時点における信用リスク・アセットの額	8,265	

みずほ銀行【連結】
2023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	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	6,680	9,452	-	-		16,132	
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	3.53	3.31	-	-		3.40	
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	1,888	2,855	-	-		4,744	
2	当四半期中の 要因別の変動額	リスク量の変動	906	418	-	-		1,324
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	△ 40	△ 233	-	-		△ 273
7		その他	△ 135	173	-	-		38
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	2,619	3,214	-	-		5,833	
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	2.59	2.78	-	-		2.69	
8c	当四半期末におけるリスク・アセット	6,808	8,939	-	-		15,748	