

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	
		2023年9月末	2023年6月末	2023年9月末	2023年6月末
1	信用リスク	43,874,204	43,180,668	3,702,780	3,643,916
2	うち、標準的手法適用分	2,292,326	2,158,369	183,386	172,669
3	うち、内部格付手法適用分	40,175,918	39,471,552	3,406,917	3,347,187
	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	1,405,959	1,550,746	112,476	124,059
4	カウンターパーティ信用リスク	4,709,725	4,566,157	384,999	372,540
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	408,755	313,116	33,921	26,040
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	832,211	1,013,316	70,433	85,343
	うち、CVAリスク	1,580,954	1,795,360	126,476	143,628
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	419,952	298,826	33,596	23,906
	その他	1,467,851	1,145,537	120,572	93,621
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	5,182,790	4,555,127	439,500	386,274
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）	5,281,990	4,678,819	447,010	395,906
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%）	468,208	447,562	39,704	37,953
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%）	110,676	69,815	8,990	5,735
11	未決済取引	2,552	1,693	212	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	1,710,458	1,584,244	136,836	126,739
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	1,582,342	1,456,070	126,587	116,485
14	うち、外部格付準拠方式適用分	127,109	127,223	10,168	10,177
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	187	182	14	14
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	819	767	65	61
16	マーケット・リスク	2,502,567	2,247,463	200,205	179,797
17	うち、標準的方式適用分	742,410	679,194	59,392	54,335
18	うち、内部モデル方式適用分	1,760,156	1,568,268	140,812	125,461
19	オペレーショナル・リスク	2,398,679	2,320,626	191,894	185,650
20	うち、基礎的手法適用分	735,402	651,509	58,832	52,120
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	1,663,276	1,669,116	133,062	133,529
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	2,065,060	1,894,384	168,653	154,691
	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)	71,509,856	68,616,855	5,720,788	5,489,348

(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	468,102	
2	当四半期中の要因別の変動額	資産の規模	11,132
3		ポートフォリオの質	△ 422
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	4,244
8		その他	△ 80
9		当四半期末時点における信用リスク・アセットの額	482,977

- 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	10,133	
2	当四半期中の要因別の変動額	資産の規模	△ 2,103
3		取引相手方の信用力	122
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	173
8		その他	△ 3
9		当四半期末時点における信用リスク・アセットの額	8,322

みずほ銀行【連結】
2023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	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	6,120	9,561	-	-		15,682	
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	3.36	3.00	-	-		3.13	
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	1,821	3,181	-	-		5,003	
2	当四半期中の 要因別の変動額	リスク量の変動	807	3,533	-	-		4,341
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	△ 74	△ 37	-	-		△ 111
7		その他	△ 128	△ 195	-	-		△ 323
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	2,426	6,483	-	-		8,909	
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	2.39	1.82	-	-		1.97	
8c	当四半期末におけるリスク・アセット	5,799	11,801	-	-		17,601	