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【単体】
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	42,954,932	42,501,050	3,636,170	3,597,262
2	うち、標準的手法適用分	-	-	-	-
3	うち、内部格付手法適用分	41,619,939	41,078,814	3,529,370	3,483,483
	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	1,334,992	1,422,236	106,799	113,778
4	カウンターパーティ信用リスク	3,126,918	2,904,538	257,150	238,283
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	38,211	40,994	3,240	3,476
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	764,919	784,946	64,865	66,563
	うち、CVAリスク	1,308,191	1,432,195	104,655	114,575
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	361,098	238,873	28,887	19,109
	その他	654,498	407,527	55,501	34,558
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	4,801,972	4,188,447	407,207	355,180
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）	5,530,934	4,928,554	468,184	417,098
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%）	489,208	447,562	41,484	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%）	110,848	69,988	9,005	5,750
11	未決済取引	1,742	1,534	147	130
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	1,667,217	1,529,826	133,377	122,386
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	1,539,101	1,401,651	123,128	112,132
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	1,005,339	1,010,973	80,427	80,877
17	うち、標準的方式適用分	149,238	99,568	11,939	7,965
18	うち、内部モデル方式適用分	856,101	911,405	68,488	72,912
19	オペレーショナル・リスク	1,663,276	1,669,116	133,062	133,529
20	うち、基礎的手法適用分	-	-	-	-
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	1,692,779	1,581,965	137,233	128,346
	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(スケールリング・ファクター勘案後)	66,293,134	63,959,980	5,303,450	5,116,798