

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	
		2023年12月末	2023年9月末	2023年12月末	2023年9月末
1	信用リスク	42,861,659	43,874,204	3,616,216	3,702,780
2	うち、標準的手法適用分	2,377,660	2,292,326	190,212	183,386
3	うち、内部格付手法適用分	39,017,426	40,175,918	3,308,677	3,406,917
	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	1,466,571	1,405,959	117,325	112,476
4	カウンターパーティ信用リスク	4,829,693	4,709,725	394,281	384,999
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	346,183	408,755	28,940	33,921
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	866,721	832,211	73,449	70,433
	うち、CVAリスク	1,856,511	1,580,954	148,520	126,476
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	387,700	419,952	31,016	33,596
	その他	1,372,577	1,467,851	112,355	120,572
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	4,820,256	5,182,790	408,757	439,500
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）	5,171,771	5,281,990	437,654	447,010
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%）	425,750	468,208	36,103	39,704
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%）	88,977	110,676	7,207	8,990
11	未決済取引	42,233	2,552	3,577	212
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	1,696,272	1,710,458	135,701	136,836
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	1,573,744	1,582,342	125,899	126,587
14	うち、外部格付準拠方式適用分	121,509	127,109	9,720	10,168
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	140	187	11	14
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	877	819	70	65
16	マーケット・リスク	2,914,910	2,502,567	233,192	200,205
17	うち、標準的方式適用分	953,978	742,410	76,318	59,392
18	うち、内部モデル方式適用分	1,960,932	1,760,156	156,874	140,812
19	オペレーショナル・リスク	2,401,391	2,398,679	192,111	191,894
20	うち、基礎的手法適用分	735,402	735,402	58,832	58,832
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	1,665,989	1,663,276	133,279	133,062
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	1,821,322	2,065,060	149,130	168,653
	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）	70,174,184	71,509,856	5,613,934	5,720,788

(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	482,977	
2	当四半期中の要因別の変動額	資産の規模	△ 14,842
3		ポートフォリオの質	3,641
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	△ 7,093
8		その他	487
9		当四半期末時点における信用リスク・アセットの額	465,169

- 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	8,322	
2	当四半期中の要因別の変動額	資産の規模	781
3		取引相手方の信用力	△ 118
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	△ 322
8		その他	4
9		当四半期末時点における信用リスク・アセットの額	8,667

みずほ銀行【連結】
2023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 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	ヘ 合計	
1a	前四半期末におけるリスク・アセット	5,799	11,801	-	-		17,601	
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	2.39	1.82	-	-		1.97	
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	2,426	6,483	-	-		8,909	
2	当四半期中の 要因別の変動額	リスク量の変動	△ 683	△ 3,453	-	-		△ 4,136
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	253	720	-	-		973
7		その他	△ 382	△ 417	-	-		△ 800
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	1,614	3,332	-	-		4,946	
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	3.71	4.08	-	-		3.96	
8c	当四半期末におけるリスク・アセット	5,998	13,611	-	-		19,609	