

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 | 42,033,136 | 42,954,932 | 3,557,804 | 3,636,170 |
| 2 | うち、標準的手法適用分 | - | - | - | - |
| 3 | うち、内部格付手法適用分 | 40,657,087 | 41,619,939 | 3,447,720 | 3,529,370 |
| | 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 | 1,376,049 | 1,334,992 | 110,083 | 106,799 |
| 4 | カウンターパーティ信用リスク | 2,853,373 | 3,126,918 | 234,271 | 257,150 |
| 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 | 35,309 | 38,211 | 2,994 | 3,240 |
| 6 | うち、期待エクスポージャー方式適用分 | 684,712 | 764,919 | 58,063 | 64,865 |
| | うち、CVAリスク | 1,274,795 | 1,308,191 | 101,983 | 104,655 |
| | うち、中央清算機関関連エクスポージャー | 328,221 | 361,098 | 26,257 | 28,887 |
| | その他 | 530,334 | 654,498 | 44,972 | 55,501 |
| 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 | 4,428,578 | 4,801,972 | 375,543 | 407,207 |
| 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） | 5,431,674 | 5,530,934 | 459,752 | 468,184 |
| 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%） | 508,692 | 489,208 | 43,137 | 41,484 |
| 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%） | 89,149 | 110,848 | 7,221 | 9,005 |
| 11 | 未決済取引 | 41,381 | 1,742 | 3,509 | 147 |
| 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 | 1,655,943 | 1,667,217 | 132,475 | 133,377 |
| 13 | うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分 | 1,533,415 | 1,539,101 | 122,673 | 123,128 |
| 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 | 866,242 | 1,005,339 | 69,299 | 80,427 |
| 17 | うち、標準的方式適用分 | 152,044 | 149,238 | 12,163 | 11,939 |
| 18 | うち、内部モデル方式適用分 | 714,197 | 856,101 | 57,135 | 68,488 |
| 19 | オペレーショナル・リスク | 1,665,989 | 1,663,276 | 133,279 | 133,062 |
| 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 | 1,665,989 | 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 | 1,399,736 | 1,692,779 | 113,635 | 137,233 |
| | 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） | 64,124,123 | 66,293,134 | 5,129,929 | 5,303,450 |