

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】
2024年3月末

(単位：百万円)

0V1: リスク・アセットの概要				
国際様式の 該当番号		イ	ロ	ハ
		リスク・アセット		所要自己資本
		2024年3月末	2023年12月末	2024年3月末
				2023年12月末
1	信用リスク	44,566,487	42,861,659	3,565,318
2	うち、標準的手法適用分	5,066,580	2,377,660	405,326
	うち、内部格付手法適用分		39,017,426	3,308,677
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	23,483,596		1,878,687
4	うち、スロットティング・クライテリア適用分	643,779		51,502
5	うち、先進的内部格付手法適用分	13,607,763		1,088,621
	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	1,764,765	1,466,571	141,181
6	カウンターパーティ信用リスク	2,501,339	4,829,693	200,107
7	うち、SA-CCR適用分	507,134		40,570
	うち、カレント・エクスポージャー方式適用分		346,183	28,940
8	うち、期待エクスポージャー方式適用分	619,461	866,721	49,556
	うち、CVAリスク		1,856,511	148,520
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	245,353	387,700	19,628
9	その他	1,129,390	1,372,577	90,351
10	CVAリスク	1,511,939		120,955
	うち、SA-CVA適用分	509,763		40,781
	うち、完全なBA-CVA適用分	878,763		70,301
	うち、限定的なBA-CVA適用分	123,412		9,873
	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	408,757
11	経過措置により適用されるマーケット・ベース方式に基づく株式等エクスポージャー	3,935,931		314,874
12	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）	3,647,536	5,171,771	291,802
13	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%）	220,379	-	17,630
	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%）	140	425,750	11
14	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%）	46,635	88,977	3,730
15	未決済取引	6,965	42,233	557
16	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	2,462,626	1,696,272	197,010
	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	125,899
17	うち、内部格付手法準拠方式適用分	1,892,401		151,392
	うち、外部格付準拠方式適用分		121,509	9,720
18	うち、外部格付準拠方式又は内部評価方式適用分	131,628		10,530
19	うち、標準的手法準拠方式適用分	437,682	140	35,014
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	913	877	73
20	マーケット・リスク	2,273,120	2,914,910	181,849
21	うち、標準的方式適用分	2,270,952	953,978	181,676
22	うち、内部モデル方式適用分	-	1,960,932	-
	うち、簡易的方式適用分	2,167		173
23	勘定間の振替分	-	-	-
24	オペレーショナル・リスク	3,084,199	2,401,391	246,735
	うち、基礎的手法適用分		735,402	58,832
	うち、粗利益配分手法適用分		-	-
	うち、先進的計測手法適用分		1,665,989	133,279
25	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	1,701,882	1,821,322	136,150
	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		-	-
26	フロア調整	-	-	-
27	合計	65,959,184	70,174,184	5,276,734
				5,613,934

注） 2023年12月末のリスク・アセットの合計は、スケーリング・ファクター勘案後の数値です。

みずほ銀行【連結】

2024年3月末

(単位：百万円)

CVA4：CVAリスク・エクスポージャーのCVAリスク相当額の変動表		
項番		CVAリスク相当額
1	前四半期末	
2	当四半期末	120,955
	変動事由の説明	

みずほ銀行【連結】
2024年3月末

(単位：百万円)

CMS1：内部モデルを用いた手法と標準的手法のリスク・アセットの比較					
項番		イ	ロ	ハ	ニ
		リスク・アセットの額			
		内部モデルを用いて算出したリスク・アセットの額	標準的な手法適用分のリスク・アセットの額	リスク・アセットの額	資本フロア計算に用いられる、標準的な手法により算出したリスク・アセットの額（フロア掛目前）
1	信用リスク	37,735,140	5,066,580	42,801,721	85,010,043
2	カウンターパーティ信用リスク	1,550,284	951,055	2,501,339	5,670,365
3	CVAリスク		1,511,939	1,511,939	1,511,939
4	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	1,892,401	570,224	2,462,626	2,509,447
5	マーケット・リスク	-	2,273,120	2,273,120	2,273,120
6	オペレーショナル・リスク		3,084,199	3,084,199	3,084,199
7	その他リスク・アセット		11,324,237	11,324,237	7,112,370
8	合計	41,177,826	24,781,357	65,959,184	107,171,486

(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		465,169
2	当四半期中の要因別 の変動額	資産の規模	11,247
3		ポートフォリオの質	△ 5,542
4		モデルの更新	-
5		手法及び方針	△ 38,904
6		買収又は売却	-
7		為替の変動	9,733
8		その他	△ 202
9	当四半期末時点における信用リスク・アセットの額		441,500

注) 1. 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。

2. 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。

3. 手法及び方針は、当局による規制の変更による計算法の変更に起因するリスク・アセットの変動額です。

4. 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。

(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		8,667
2	当四半期中の要因別の変動額	資産の規模	△ 1,044
3		取引相手方の信用力	△ 188
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）	△ 1,606
6		買収又は売却	-
7		為替の変動	370
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		6,194