

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】
2024年3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		リスク・アセット		所要自己資本		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	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	44,037,664	42,033,136	3,523,013	3,557,804				
2	うち、標準的手法適用分	3,737,341	-	298,987	-				
	うち、内部格付手法適用分		40,657,087		3,447,720				
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	23,845,817		1,907,665					
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	14,261,681		1,140,934					
	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	1,549,044	1,376,049	123,923	110,083				
6	カウンターパーティ信用リスク	1,285,825	2,853,373	102,866	234,271				
7	うち、SA-CCR適用分	33,898	-	2,711	-				
	うち、カレント・エクスポージャー方式適用分		35,309		2,994				
8	うち、期待エクスポージャー方式適用分	507,443	684,712	40,595	58,063				
	うち、CVAリスク		1,274,795		101,983				
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	198,758	328,221	15,900	26,257				
9	その他	545,724	530,334	43,657	44,972				
10	CVAリスク	849,743		67,979					
	うち、SA-CVA適用分	514,833		41,186					
	うち、完全なBA-CVA適用分	334,910		26,792					
	うち、限定的なBA-CVA適用分	-		-					
	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		375,543				
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	3,520,061		281,604					
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）	3,890,194	5,431,674	311,215	459,752				
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%）	220,149	-	17,611	-				
	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	508,692	11	43,137				
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%）	46,808	89,149	3,744	7,221				
15	未決済取引	6,248	41,381	499	3,509				
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	2,439,270	1,655,943	195,141	132,475				
	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		122,673				
17	うち、内部格付手法準拠方式適用分	1,871,426		149,714					
	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	435,302	140	34,824	11				
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	913	877	73	70				
20	マーケット・リスク	907,722	866,242	72,617	69,299				
21	うち、標準的方式適用分	907,722	152,044	72,617	12,163				
22	うち、内部モデル方式適用分	-	714,197	-	57,135				
	うち、簡易的方式適用分	-		-					
23	勘定間の振替分	-	-	-	-				
24	オペレーショナル・リスク	1,901,366	1,665,989	152,109	133,279				
	うち、標準的手法適用分		-		-				
	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	1,251,134	1,399,736	100,090	113,635				
	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	60,356,330	64,124,123	4,828,506	5,129,929				

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。