

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6月末

(単位：百万円)

OV1: 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					
		2024年6月末	2024年3月末	2024年6月末	2024年3月末				
1	信用リスク	46,079,900	44,566,487	3,686,392	3,565,318				
2	うち、標準的手法適用分	5,096,299	5,066,580	407,703	405,326				
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	24,945,947	23,483,596	1,995,675	1,878,687				
4	うち、スロットティング・クライテリア適用分	616,145	643,779	49,291	51,502				
5	うち、先進的内部格付手法適用分	13,618,390	13,607,763	1,089,471	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	1,803,116	1,764,765	144,249	141,181				
6	カウンターパーティ信用リスク	2,667,601	2,501,339	213,408	200,107				
7	うち、SA-CCR適用分	523,079	507,134	41,846	40,570				
8	うち、期待エクスポージャー方式適用分	690,480	619,461	55,238	49,556				
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	253,328	245,353	20,266	19,628				
9	その他	1,200,713	1,129,390	96,057	90,351				
10	CVAリスク	1,580,516	1,511,939	126,441	120,955				
	うち、SA-CVA適用分	556,832	509,763	44,546	40,781				
	うち、完全なBA-CVA適用分	872,935	878,763	69,834	70,301				
	うち、限定的なBA-CVA適用分	150,748	123,412	12,059	9,873				
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	1,989,996	3,935,931	159,199	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）	3,449,370	3,647,536	275,949	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（マンドレート方式）	-	-	-	-				
	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%）	182,159	220,379	14,572	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%）	150	140	12	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%）	144,437	46,635	11,554	3,730				
15	未決済取引	8,804	6,965	704	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	2,713,735	2,462,626	217,098	197,010				
17	うち、内部格付手法準拠方式適用分	2,042,710	1,892,401	163,416	151,392				
18	うち、外部格付準拠方式又は内部評価方式適用分	72,581	131,628	5,806	10,530				
19	うち、標準的手法準拠方式適用分	597,516	437,682	47,801	35,014				
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	927	913	74	73				
20	マーケット・リスク	2,265,424	2,273,120	181,233	181,849				
21	うち、標準的方式適用分	2,260,151	2,270,952	180,812	181,676				
22	うち、内部モデル方式適用分	-	-	-	-				
	うち、簡易的方式適用分	5,273	2,167	421	173				
23	勘定間の振替分	-	-	-	-				
24	オペレーショナル・リスク	3,084,199	3,084,199	246,735	246,735				
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	1,988,869	1,701,882	159,109	136,150				
26	フロア調整	-	-	-	-				
27	合計	66,155,164	65,959,184	5,292,413	5,276,734				

みずほ銀行【連結】

2024年6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	120,955
2	当四半期末	126,441
	変動事由の説明	取引相手方のクレジット・スプレッド・リスクによるCVAリスク相当額の増加に伴い、全体のCVAリスク相当額は増加しております。

みずほ銀行【連結】

2024年6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	39,180,484	5,096,299	44,276,783	87,170,642
2	カウンターパーティ信用リスク	1,630,218	1,037,383	2,667,601	5,996,925
3	CVAリスク		1,580,516	1,580,516	1,580,516
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	2,042,710	671,025	2,713,735	2,646,886
5	マーケット・リスク	-	2,265,424	2,265,424	2,265,424
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		9,566,903	9,566,903	6,878,834
8	合計	42,853,413	23,301,751	66,155,164	109,623,430

(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	441,500	
2	当四半期中の要因別の変動額	資産の規模	△ 15,194
3		ポートフォリオの質	1,596
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	11,543
8		その他	-
9		当四半期末時点における信用リスク・アセットの額	439,445

- 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手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。

みずほ銀行【連結】
2024年6月末

(単位：億円)

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	6,194	
2	当四半期中の要因別の変動額	資産の規模	381
3		取引相手方の信用力	17
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	311
8		その他	-
9	当四半期末時点における信用リスク・アセットの額	6,904	