

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9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9月末	2024年6月末	2024年9月末	2024年6月末				
1	信用リスク	43,747,724	46,079,900	3,499,817	3,686,392				
2	うち、標準的手法適用分	4,876,653	5,096,299	390,132	407,703				
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	23,593,608	24,945,947	1,887,488	1,995,675				
4	うち、スロットティング・クライテリア適用分	558,623	616,145	44,689	49,291				
5	うち、先進的内部格付手法適用分	13,259,189	13,618,390	1,060,735	1,089,471				
	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	1,459,649	1,803,116	116,771	144,249				
6	カウンターパーティ信用リスク	2,362,310	2,667,601	188,984	213,408				
7	うち、SA-CCR適用分	412,088	523,079	32,967	41,846				
8	うち、期待エクスポージャー方式適用分	757,886	690,480	60,630	55,238				
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	205,594	253,328	16,447	20,266				
9	その他	986,740	1,200,713	78,939	96,057				
10	CVAリスク	1,421,916	1,580,516	113,753	126,441				
	うち、SA-CVA適用分	509,255	556,832	40,740	44,546				
	うち、完全なBA-CVA適用分	782,607	872,935	62,608	69,834				
	うち、限定的なBA-CVA適用分	130,054	150,748	10,404	12,059				
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	1,627,160	1,989,996	130,172	159,199				
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）	3,382,771	3,449,370	270,621	275,949				
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%）	133,562	182,159	10,684	14,572				
	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	150	12	12				
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%）	243,168	144,437	19,453	11,554				
15	未決済取引	2,489	8,804	199	704				
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	2,787,634	2,713,735	223,010	217,098				
17	うち、内部格付手法準拠方式適用分	2,143,389	2,042,710	171,471	163,416				
18	うち、外部格付準拠方式又は内部評価方式適用分	76,084	72,581	6,086	5,806				
19	うち、標準的手法準拠方式適用分	567,159	597,516	45,372	47,801				
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	1,000	927	80	74				
20	マーケット・リスク	2,489,742	2,265,424	199,179	181,233				
21	うち、標準的方式適用分	2,485,969	2,260,151	198,877	180,812				
22	うち、内部モデル方式適用分	-	-	-	-				
	うち、簡易的方式適用分	3,773	5,273	301	421				
23	勘定間の振替分	-	-	-	-				
24	オペレーショナル・リスク	3,533,118	3,084,199	282,649	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	1,828,593	1,988,869	146,287	159,109				
26	フロア調整	-	-	-	-				
27	合計	63,560,342	66,155,164	5,084,827	5,292,413				

みずほ銀行【連結】

2024年9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	126,441
2	当四半期末	113,753
	変動事由の説明	EAD減少によるBA-CVAのCVAリスク相当額の減少に伴い、全体のCVAリスク相当額は減少しております。

みずほ銀行【連結】

2024年9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	37,411,420	4,876,653	42,288,074	83,259,435
2	カウンターパーティ信用リスク	1,533,021	829,288	2,362,310	5,488,343
3	CVAリスク		1,421,916	1,421,916	1,421,916
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	2,143,389	644,244	2,787,634	2,565,061
5	マーケット・リスク	-	2,489,742	2,489,742	2,489,742
6	オペレーショナル・リスク		3,533,118	3,533,118	3,533,118
7	その他リスク・アセット		8,677,545	8,677,545	6,151,214
8	合計	41,087,832	22,472,510	63,560,342	104,908,833

(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	439,445	
2	当四半期中の要因別の変動額	資産の規模	△ 7,457
3		ポートフォリオの質	5,026
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	△ 20,125
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	416,888	

- 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等に起因するリスク・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9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	6,904	
2	当四半期中の要因別の変動額	資産の規模	1,339
3		取引相手方の信用力	△ 59
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	△ 605
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	7,578	