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12月末

(単位：百万円)

OV1: リスク・アセットの概要					
国際様式の 該当番号		イ	ロ	ハ	ニ
		リスク・アセット		所要自己資本	
		2024年12月末	2024年9月末	2024年12月末	2024年9月末
1	信用リスク	46,081,431	43,747,724	3,686,514	3,499,817
2	うち、標準的手法適用分	4,730,684	4,876,653	378,454	390,132
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	25,196,529	23,593,608	2,015,722	1,887,488
4	うち、スロッシング・クライテリア適用分	561,929	558,623	44,954	44,689
5	うち、先進的内部格付手法適用分	14,020,641	13,259,189	1,121,651	1,060,735
	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	1,571,647	1,459,649	125,731	116,771
6	カウンターパーティ信用リスク	2,605,088	2,362,310	208,407	188,984
7	うち、SA-CCR適用分	477,686	412,088	38,214	32,967
8	うち、期待エクスポージャー方式適用分	739,106	757,886	59,128	60,630
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	230,873	205,594	18,469	16,447
9	その他	1,157,422	986,740	92,593	78,939
10	CVAリスク	1,528,539	1,421,916	122,283	113,753
	うち、SA-CVA適用分	521,169	509,255	41,693	40,740
	うち、完全なBA-CVA適用分	885,229	782,607	70,818	62,608
	うち、限定的なBA-CVA適用分	122,140	130,054	9,771	10,404
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	1,830,283	1,627,160	146,422	130,172
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）	3,852,769	3,382,771	308,222	270,621
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%）	131,739	133,562	10,539	10,684
	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	-	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%）	203,163	243,168	16,253	19,453
15	未決済取引	70,172	2,489	5,613	199
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	3,192,608	2,787,634	255,408	223,010
17	うち、内部格付手法準拠方式適用分	2,582,741	2,143,389	206,619	171,471
18	うち、外部格付準拠方式又は内部評価方式適用分	74,068	76,084	5,925	6,086
19	うち、標準的手法準拠方式適用分	534,771	567,159	42,781	45,372
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	1,027	1,000	82	80
20	マーケット・リスク	2,076,698	2,489,742	166,135	199,179
21	うち、標準的方式適用分	2,073,131	2,485,969	165,850	198,877
22	うち、内部モデル方式適用分	-	-	-	-
	うち、簡易的方式適用分	3,567	3,773	285	301
23	勘定間の振替分	-	-	-	-
24	オペレーショナル・リスク	3,533,118	3,533,118	282,649	282,649
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	2,051,009	1,828,593	164,080	146,287
26	フロア調整	-	-	-	-
27	合計	67,156,622	63,560,342	5,372,531	5,084,827

みずほ銀行【連結】

2024年12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	113,753
2	当四半期末	122,283
	変動事由の説明	EAD増加によるBA-CVAの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12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	39,779,099	4,730,684	44,509,784	86,677,940
2	カウンターパーティ信用リスク	1,682,972	922,116	2,605,088	5,650,978
3	CVAリスク		1,528,539	1,528,539	1,528,539
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	2,582,741	609,866	3,192,608	2,968,136
5	マーケット・リスク	-	2,076,698	2,076,698	2,076,698
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		9,710,785	9,710,785	6,866,486
8	合計	44,044,813	23,111,809	67,156,622	109,301,897

みずほ銀行【連結】
2024年12月末

(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	416,888	
2	当四半期中の要因別の変動額	資産の規模	9,693
3		ポートフォリオの質	1,945
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	15,490
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	444,017

- 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12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	7,578	
2	当四半期中の要因別の変動額	資産の規模	△ 728
3		取引相手方の信用力	91
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	449
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	7,391