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】 2025年9月末

(単位:百万円)

「OV1∶リスク・アセットの概要								
	, c, 1 0 mg	1		/\	=			
国際様式の		リスク・	リスク・アセット					
該当番号		2025年9月末	2025年6月末	2025年9月末	2025年6月末			
1	信用リスク	44, 840, 475	44, 155, 031	3, 587, 238	3, 532, 402			
2	うち、標準的手法適用分	6, 087, 681	5, 701, 897	487, 014	456, 151			
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	23, 617, 007	23, 328, 206	1, 889, 360	1, 866, 256			
4	うち、スロッティング・クライテリア適用分	349, 047	464, 882	27, 923	37, 190			
5	うち、先進的内部格付手法適用分	13, 285, 166	13, 078, 724	1, 062, 813	1, 046, 297			
	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, 501, 570	1, 581, 320	120, 125	126, 505			
6	カウンターパーティ信用リスク	2, 356, 670	2, 179, 931	188, 533	174, 394			
7	うち、SA一CCR適用分	423, 431	407, 806	33, 874	32, 624			
8	うち、期待エクスポージャー方式適用分	759, 224	707, 788	60, 737	56, 623			
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	239, 902	208, 555	19, 192	16, 684			
9		934, 110	855, 780	74, 728	68, 462			
10	CVAリスク	1, 811, 832	1, 647, 806	144, 946	131, 824			
	うち、SAーCVA適用分	522, 905	527, 374	41, 832	42, 189			
	うち、完全なBAーCVA適用分	1, 137, 857	984, 238	91, 028	78, 739			
	うち、限定的なBA-CVA適用分	151, 069	136, 193	12, 085	10, 895			
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, 973, 667	2, 703, 964	157, 893	216, 317			
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・スル一方式)	3, 914, 265	3, 875, 382	313, 141	310, 030			
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(マンデート方式)		7, 529	-	602			
	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%)	146, 287	130, 660	11, 702	10, 452			
	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%)		_	-				
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%)	157, 544	196, 124	12, 603	15, 689			
15	未決済取引	17, 985	4, 407	1, 438	352			
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, 288, 364	3, 302, 807	263, 069	264, 224			
17	うち、内部格付手法準拠方式適用分	2, 589, 623	2, 646, 269	207, 169	211, 701			
18	うち、外部格付準拠方式又は内部評価方式適用分	47, 329	53, 049	3, 786	4, 243			
19	うち、標準的手法準拠方式適用分	650, 091	602, 266	52, 007	48, 181			
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	1, 319	1, 223	105	97			
20	マーケット・リスク	2, 858, 467	2, 611, 299	228, 677	208, 903			
21	うち、標準的方式適用分	2, 856, 302	2, 608, 800	228, 504	208, 704			
22	うち、内部モデル方式適用分		- 0.400	- 170	-			
00	しから、簡易的方式適用分	2, 164	2, 499	173	199			
23	勘定間の振替分	- 0.000 550		-	-			
24	オペレーショナル・リスク	3, 922, 559	3, 658, 025	313, 804	292, 642			
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, 344, 558	2, 526, 068	187, 564	202, 085			
26	フロア調整	-	-	-	-			
27	合計	67, 632, 678	66, 999, 039	5, 410, 614	5, 359, 923			

みずほ銀行【連結】

2025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	131, 824				
2	当四半期末	144, 947				
	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】

2025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		1	П	/\	=					
		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, 251, 222	6, 087, 681	43, 338, 904	86, 603, 560					
2	カウンターパーティ信用リスク	1, 564, 082	792, 587	2, 356, 670	5, 347, 981					
3	CVAリスク		1, 811, 832	1, 811, 832	1, 811, 832					
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, 589, 623	698, 741	3, 288, 364	2, 764, 050					
5	マーケット・リスク	-	2, 858, 467	2, 858, 467	2, 858, 467					
6	オペレーショナル・リスク		3, 922, 559	3, 922, 559	3, 922, 559					
7	その他リスク・アセット		10, 055, 880	10, 055, 880	7, 479, 484					
8	승 計	41, 404, 928	26, 227, 750	67, 632, 678	110, 787, 936					