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】

2026年9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	
		2026年9月末	2026年6月末	2026年9月末	2026年6月末
1	信用リスク	49,800,599	49,365,420	3,984,047	3,949,233
2	うち、標準的手法適用分	7,267,137	7,373,941	581,370	589,915
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	26,181,076	26,185,271	2,094,486	2,094,821
4	うち、スロッティング・クライテリア適用分	349,769	319,370	27,981	25,549
5	うち、先進的内部格付手法適用分	14,522,921	13,994,837	1,161,833	1,119,587
	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	1,479,694	1,491,998	118,375	119,359
6	カウンターパーティ信用リスク	3,203,772	2,642,598	256,301	211,407
7	うち、SA－CCR適用分	927,185	515,204	74,174	41,216
8	うち、期待エクスポージャー方式適用分	901,739	893,476	72,139	71,478
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	178,355	287,285	14,268	22,982
9	その他	1,196,491	946,631	95,719	75,730
10	CVAリスク	2,167,892	1,964,745	173,431	157,179
	うち、SA－CVA適用分	561,391	563,439	44,911	45,075
	うち、完全なBA－CVA適用分	1,316,117	1,232,103	105,289	98,568
	うち、限定的なBA－CVA適用分	290,384	169,201	23,230	13,536
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	2,454,092	1,921,512	196,327	153,720
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）	4,803,142	4,691,437	384,251	375,315
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）	－	－	－	－
	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%）	225,430	299,684	18,034	23,974
	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%）	3,962	102,669	317	8,213
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%）	212,842	233,795	17,027	18,703
15	未決済取引	1,698	3,807	135	304
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	3,744,920	3,849,655	299,593	307,972
17	うち、内部格付手法準拠方式適用分	2,923,449	3,012,636	233,875	241,010
18	うち、外部格付準拠方式又は内部評価方式適用分	69,248	71,346	5,539	5,707
19	うち、標準的手法準拠方式適用分	752,223	765,651	60,177	61,252
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	－	21	－	1
20	マーケット･リスク	3,539,204	3,655,165	283,136	292,413
21	うち、標準的方式適用分	3,535,801	3,651,819	282,864	292,145
22	うち、内部モデル方式適用分	－	－	－	－
	うち、簡易的方式適用分	3,403	3,346	272	267
23	勘定間の振替分	－	－	－	－
24	オペレーショナル・リスク	4,706,451	4,255,804	376,516	340,464
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	3,453,065	2,768,613	276,245	221,489
26	フロア調整	－	－	－	－
27	合計	78,317,077	75,754,910	6,265,366	6,060,392

みずほ銀行【連結】

2026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	157,179
2	当四半期末	173,431
	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】

2026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	41,053,767	7,267,137	48,320,905	94,742,114
2	カウンターパーティ信用リスク	1,733,619	1,470,152	3,203,772	5,775,655
3	CVAリスク		2,167,892	2,167,892	2,167,892
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	2,923,449	821,471	3,744,920	2,993,355
5	マーケット・リスク	－	3,539,204	3,539,204	3,539,204
6	オペレーショナル・リスク		4,706,451	4,706,451	4,706,451
7	その他リスク・アセット		12,633,930	12,633,930	9,997,771
8	合計	45,710,836	32,606,241	78,317,077	123,922,446