

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】
平成30年6月末

(単位：百万円)

0V1：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	
		平成30年6月末	平成30年3月末	平成30年6月末	平成30年3月末
1	信用リスク	37,448,409	37,094,284	3,162,595	3,132,634
2	うち、標準的手法適用分	1,361,003	1,416,385	108,880	113,310
3	うち、内部格付手法適用分	34,733,986	34,394,034	2,945,442	2,916,614
	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	1,353,420	1,283,864	108,273	49,691
4	カウンターパーティ信用リスク	3,599,640	3,787,007	292,332	307,566
5	うち、S A C C R 適用分	-	-	-	-
	うち、カレント・エクスポージャー方式適用分	127,898	112,212	10,743	9,396
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	709,409	793,535	60,017	67,149
	うち、C V A リスク	2,102,551	2,312,515	168,204	185,001
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	129,582	112,749	10,366	9,019
	その他	530,199	455,993	43,001	36,999
7	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	2,516,904	2,264,413	213,433	192,022
	複数の資産及び取引を裏付けとするエクスポージャー	-	-	-	-
	信用リスク・アセットのみなし計算が適用されるエクスポージャー	3,311,868	3,065,417	280,016	259,115
11	未決済取引	3,595	4,276	304	362
12	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	344,980	346,037	29,254	29,343
13	うち、内部格付手法における外部格付準拠方式又は内部評価方式適用分	111,961	108,655	9,494	9,213
14	うち、内部格付手法における指定関数方式適用分	224,519	228,881	19,039	19,409
15	うち、標準的手法適用分	-	-	-	-
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	8,500	8,500	720	720
16	マーケット・リスク	1,236,931	1,141,339	98,954	91,307
17	うち、標準的方式適用分	609,178	501,140	48,734	40,091
18	うち、内部モデル方式適用分	627,753	640,198	50,220	51,215
19	オペレーショナル・リスク	2,458,427	2,456,384	196,674	196,510
20	うち、基礎的手法適用分	427,296	427,296	34,183	34,183
21	うち、粗利益配分手法適用分	-	-	-	-
22	うち、先進的計測手法適用分	2,031,130	2,029,087	162,490	162,327
23	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	619,049	704,174	51,195	58,025
	経過措置によりリスク・アセットの額に算入されるものの額	-	-	-	-
24	フロア調整	-	-	-	-
25	合計(スケーリング・ファクター勘案後)	54,059,521	53,336,100	4,324,761	4,266,888

みずほ銀行【連結】
平成30年6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	382,559	
2	当四半期中の要因別の変動額	資産の規模	3,129
3		ポートフォリオの質	△ 926
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	2,950
8		その他	23
9	当四半期末時点における信用リスク・アセットの額	387,736	

- 注) 1. カウンターパーティ信用リスク、証券化エクスポージャー、信用リスク・アセットのみなし計算が適用されるエクスポージャーを除いています。
2. 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。
3. 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。
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】
平成30年6月末

(単位：億円)

CCR7：期待エクスポージャー方式を用いたカウンターパーティ信用リスク・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	7,935	
2	当四半期中の要因別の変動額	資産の規模	△ 922
3		取引相手方の信用力	△ 27
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	96
8		その他	11
9	当四半期末時点における信用リスク・アセットの額	7,094	

みずほ銀行【連結】
平成30年6月末

(単位：億円)

MR2：内部モデル方式を適用して算出されたリスク・アセットの額の変動要因							
項番		イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ
		バリュー・アット・リスク	ストレス・バリュー・アット・リスク	追加的リスク	包括的リスク	その他	合計
1a	前四半期末におけるリスク・アセット	1,856	4,545	-	-		6,401
1b	前四半期末における自己資本比率規制上のリスク・アセット額への調整	2.96	3.04	-	-		3.01
1c	前四半期末の算出基準日における内部モデル方式の算出額	626	1,493	-	-		2,120
2	当四半期中の 要因別の変動額	リスク量の変動	△ 171	△ 76	-	-	△ 248
3		モデルの更新又は変更	-	-	-	-	-
4		手法及び方針	-	-	-	-	-
5		買収及び売却	-	-	-	-	-
6		為替の変動	592	359	-	-	951
7		その他	△ 269	12	-	-	△ 257
8a	当四半期末の算出基準日における内部モデル方式の算出額	777	1,788	-	-		2,566
8b	当四半期末における自己資本比率規制上のリスク・アセット額への調整	2.29	2.51	-	-		2.44
8c	当四半期末におけるリスク・アセット	1,783	4,493	-	-		6,277