

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9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9月末	平成30年6月末	平成30年9月末	平成30年6月末
1	信用リスク	37,866,261	37,448,409	3,197,804	3,162,595
2	うち、標準的手法適用分	1,509,468	1,361,003	120,757	108,880
3	うち、内部格付手法適用分	35,104,923	34,733,986	2,976,897	2,945,442
	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	1,251,868	1,353,420	100,149	108,273
4	カウンターパーティ信用リスク	3,508,898	3,599,640	284,854	292,332
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	104,963	127,898	8,792	10,743
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	673,453	709,409	57,043	60,017
	うち、C V A リスク	2,020,759	2,102,551	161,660	168,204
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	131,048	129,582	10,483	10,366
	その他	578,674	530,199	46,874	43,001
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	2,216,923	2,516,904	187,995	213,433
	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	2,997,504	3,311,868	253,360	280,016
11	未決済取引	1,110	3,595	93	304
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	404,288	344,980	34,283	29,254
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	114,719	111,961	9,728	9,494
14	うち、内部格付手法における指定関数方式適用分	281,068	224,519	23,834	19,039
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	2,202,261	1,236,931	176,180	98,954
17	うち、標準的方式適用分	695,483	609,178	55,638	48,734
18	うち、内部モデル方式適用分	1,506,778	627,753	120,542	50,220
19	オペレーショナル・リスク	2,349,951	2,458,427	187,996	196,674
20	うち、基礎的手法適用分	441,936	427,296	35,354	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	1,908,015	2,031,130	152,641	162,490
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	836,599	619,049	68,817	51,195
	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)	54,892,326	54,059,521	4,391,386	4,324,761

みずほ銀行【連結】
平成30年9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	387,736	
2	当四半期中の要因別 の変動額	資産の規模	2,851
3		ポートフォリオの質	4,032
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	3,542
8		その他	362
9	当四半期末時点における信用リスク・アセットの額	390,459	

- 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9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	7,094	
2	当四半期中の要因別の変動額	資産の規模	485
3		取引相手方の信用力	11
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	131
8		その他	5
9	当四半期末時点における信用リスク・アセットの額	6,734	

みずほ銀行【連結】
平成30年9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	1,783	4,493	-	-		6,277	
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	2.29	2.51	-	-		2.44	
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	777	1,788	-	-		2,566	
2	当四半期中の要因別の変動額	リスク量の変動	351	2,514	-	-		2,865
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	260	347	-	-		607
7		その他	377	846	-	-		1,223
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	1,011	3,804	-	-		4,816	
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	3.29	3.08	-	-		3.12	
8c	当四半期末におけるリスク・アセット	3,334	11,733	-	-		15,067	