

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】
2018年12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	
		2018年12月末	2018年9月末	2018年12月末	2018年9月末
1	信用リスク	37,832,552	37,866,261	3,194,077	3,197,804
2	うち、標準的手法適用分	1,556,493	1,509,468	124,519	120,757
3	うち、内部格付手法適用分	34,890,216	35,104,923	2,958,690	2,976,897
	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	1,385,842	1,251,868	110,867	100,149
4	カウンターパーティ信用リスク	3,871,405	3,508,898	314,687	284,854
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	144,916	104,963	12,181	8,792
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	737,532	673,453	62,485	57,043
	うち、C V A リスク	2,175,734	2,020,759	174,058	161,660
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	203,822	131,048	16,305	10,483
	その他	609,399	578,674	49,656	46,874
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	2,901,462	2,216,923	246,044	187,995
	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	3,331,607	2,997,504	281,693	253,360
11	未決済取引	8,581	1,110	726	93
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	400,604	404,288	33,971	34,283
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	97,640	114,719	8,279	9,728
14	うち、内部格付手法における指定関数方式適用分	294,464	281,068	24,970	23,834
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	1,840,897	2,202,261	147,271	176,180
17	うち、標準的方式適用分	747,847	695,483	59,827	55,638
18	うち、内部モデル方式適用分	1,093,050	1,506,778	87,444	120,542
19	オペレーショナル・リスク	2,349,112	2,349,951	187,928	187,996
20	うち、基礎的手法適用分	441,936	441,936	35,354	35,354
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	1,907,175	1,908,015	152,574	152,641
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	1,058,867	836,599	86,662	68,817
	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)	56,163,298	54,892,326	4,493,063	4,391,386

みずほ銀行【連結】
2018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	390,459	
2	当四半期中の要因別の変動額	資産の規模	10,055
3		ポートフォリオの質	1,197
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	3,851
8		その他	482
9		当四半期末時点における信用リスク・アセットの額	397,378

- 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】
2018年12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	6,734	
2	当四半期中の要因別の変動額	資産の規模	832
3		取引相手方の信用力	26
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	161
8		その他	3
9		当四半期末時点における信用リスク・アセットの額	7,375

みずほ銀行【連結】
2018年12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 バリュー・ アット・ リスク	ロ ストレス・ バリュー・ アット・ リスク	ハ 追加的 リスク	ニ 包括的 リスク	ホ その他	ヘ 合計	
1a	前四半期末におけるリスク・アセット	3,334	11,733	-	-		15,067	
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	3.29	3.08	-	-		3.12	
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	1,011	3,804	-	-		4,816	
2	当四半期中の 要因別の変動額	リスク量の変動	△ 415	△ 1,100	-	-		△ 1,515
3		モデルの更新又は変更	30	49	-	-		79
4		手法及び方針	-	-	-	-		-
5		買収及び売却	-	-	-	-		-
6		為替の変動	△ 256	395	-	-		139
7		その他	286	△ 1,220	-	-		△ 934
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	656	1,928	-	-		2,585	
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	4.04	4.29	-	-		4.22	
8c	当四半期末におけるリスク・アセット	2,652	8,278	-	-		10,930	