

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】
2019年3月末

(単位：百万円)

OV1: リスク・アセットの概要		イ	ロ	ハ	ニ
国際様式の 該当番号		リスク・アセット		所要自己資本	
		2019年3月末	2018年12月末	2019年3月末	2018年12月末
1	信用リスク	36,399,476	37,832,552	3,072,959	3,194,077
2	うち、標準的手法適用分	1,565,080	1,556,493	125,206	124,519
3	うち、内部格付手法適用分	33,541,908	34,890,216	2,844,353	2,958,690
	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	1,292,488	1,385,842	103,399	110,867
4	カウンターパーティ信用リスク	3,980,498	3,871,405	323,392	314,687
5	うち、SA-CCR適用分	-	-	-	-
	うち、カレント・エクスポージャー方式適用分	92,532	144,916	7,754	12,181
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	791,411	737,532	67,029	62,485
	うち、CVAリスク	2,317,239	2,175,734	185,379	174,058
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	151,298	203,822	12,103	16,305
	その他	628,016	609,399	51,125	49,656
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	1,975,007	2,901,462	167,480	246,044
8	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）	2,441,995	-	205,872	-
9	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（マナード方式）	-	-	-	-
	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%）	-	-	-	-
	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%）	248,534	-	21,075	-
10	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%）	12,833	-	1,031	-
	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	-	281,693
11	未決済取引	2,646	8,581	224	726
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	966,325	400,604	77,306	33,971
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	728,667	-	58,293	-
14	うち、外部格付準拠方式適用分	229,157	-	18,332	-
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	-	-	-	-
	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	-	8,279
	うち、内部格付手法における指定関数方式適用分	-	294,464	-	24,970
	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	680	720
16	マーケット・リスク	1,386,808	1,840,897	110,944	147,271
17	うち、標準的方式適用分	675,741	747,847	54,059	59,827
18	うち、内部モデル方式適用分	711,067	1,093,050	56,885	87,444
19	オペレーショナル・リスク	2,301,451	2,349,112	184,116	187,928
20	うち、基礎的手法適用分	460,605	441,936	36,848	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	1,840,845	1,907,175	147,267	152,574
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	986,300	1,058,867	81,484	86,662
	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)	53,073,603	56,163,298	4,245,888	4,493,063

(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	397,378	
2	当四半期中の要因別の変動額	資産の規模	△ 5,925
3		ポートフォリオの質	△ 16,236
4		モデルの更新	-
5		手法及び方針	△ 2,241
6		買収又は売却	-
7		為替の変動	145
8		その他	70
9	当四半期末時点における信用リスク・アセットの額	373,190	

- 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. 手法及び方針は、当局による規制の変更による計算手法の変更に起因するリスク・アセットの変動額です。
5. 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】
2019年3月末

(単位：億円)

GCR7：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	7,375	
2	当四半期中の要因別の変動額	資産の規模	981
3		取引相手方の信用力	△ 459
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	19
8		その他	△ 2
9	当四半期末時点における信用リスク・アセットの額	7,914	

みずほ銀行【連結】
2019年3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	2,652	8,278	-	-		10,930
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	4.04	4.29	-	-		4.22
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	656	1,928	-	-		2,585
2	当四半期中の 要因別の変動額	リスク量の変動	△ 166	△ 2	-	-	△ 168
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	△ 15	76	-	-	60
7		その他	10	△ 120	-	-	△ 110
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	484	1,882	-	-		2,367
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	4.22	2.68	-	-		3.00
8c	当四半期末におけるリスク・アセット	2,049	5,060	-	-		7,110