

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6月末

(単位：百万円)

0V1: 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6月末	2019年3月末	2019年6月末	2019年3月末
1	信用リスク	36,167,955	36,399,476	3,053,600	3,072,959
2	うち、標準的手法適用分	1,568,743	1,565,080	125,499	125,206
3	うち、内部格付手法適用分	33,367,470	33,541,908	2,829,561	2,844,353
	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	1,231,740	1,292,488	98,539	103,399
4	カウンターパーティ信用リスク	4,128,185	3,980,498	335,714	323,392
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	118,463	92,532	9,962	7,754
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	873,633	791,411	74,018	67,029
	うち、CVAリスク	2,365,202	2,317,239	189,216	185,379
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	158,699	151,298	12,695	12,103
	その他	612,187	628,016	49,821	51,125
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	2,011,704	1,975,007	170,592	167,480
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）	3,999,133	2,441,995	337,885	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（マンドート方式）	-	-	-	-
	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%）	-	-	-	-
	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%）	227,986	248,534	19,333	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%）	11,703	12,833	936	1,031
11	未決済取引	1,744	2,646	147	224
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	1,022,146	966,325	81,771	77,306
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	788,458	728,667	63,076	58,293
14	うち、外部格付準拠方式適用分	225,188	229,157	18,015	18,332
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	-	-	-	-
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	8,500	8,500	680	680
16	マーケット・リスク	1,593,313	1,386,808	127,465	110,944
17	うち、標準的方式適用分	765,471	675,741	61,237	54,059
18	うち、内部モデル方式適用分	827,842	711,067	66,227	56,885
19	オペレーショナル・リスク	2,307,031	2,301,451	184,562	184,116
20	うち、基礎的手法適用分	460,605	460,605	36,848	36,848
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	1,846,425	1,840,845	147,714	147,267
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	1,033,142	986,300	85,291	81,484
	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(スケールリング・ファクター勘案後)	54,966,252	53,073,603	4,397,300	4,245,888

(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	373,190	
2	当四半期中の要因別の変動額	資産の規模	148
3		ポートフォリオの質	3,202
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	△ 3,651
8		その他	△ 486
9	当四半期末時点における信用リスク・アセットの額	372,402	

- 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6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	7,914	
2	当四半期中の要因別の変動額	資産の規模	1,040
3		取引相手方の信用力	2
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	△ 212
8		その他	△ 8
9	当四半期末時点における信用リスク・アセットの額	8,736	

みずほ銀行【連結】  
2019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 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	
2	前四半期末におけるリスク・アセット	2,049	5,060	-	-		7,110	
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	4.22	2.68	-	-		3.00	
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	484	1,882	-	-		2,367	
2	当四半期中の 要因別の変動額	リスク量の変動	266	△ 250	-	-		15
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	△ 137	△ 169	-	-		△ 307
7		その他	192	83	-	-		275
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	805	1,545	-	-		2,351	
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	2.94	3.81	-	-		3.52	
8c	当四半期末におけるリスク・アセット	2,375	5,902	-	-		8,278	