

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【単体】
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	35,486,419	35,812,727	3,004,308	3,031,395
2	うち、標準的手法適用分	-	-	-	-
3	うち、内部格付手法適用分	34,457,293	34,661,963	2,921,978	2,939,334
	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	1,029,126	1,150,763	82,330	92,061
4	カウンターパーティ信用リスク	3,290,364	3,324,835	268,107	270,765
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	55,553	34,664	4,710	2,939
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	786,228	777,715	66,672	65,950
	うち、CVAリスク	2,154,522	2,205,586	172,361	176,446
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	119,461	123,798	9,556	9,903
	その他	174,598	183,070	14,805	15,524
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	1,760,515	1,743,957	149,291	147,887
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）	4,118,104	2,554,068	347,974	215,376
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%）	290,114	250,962	24,601	21,281
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	1,641	2,622	139	222
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	997,844	943,680	79,827	75,494
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	764,156	706,022	61,132	56,481
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	833,591	746,021	66,687	59,681
17	うち、標準的方式適用分	370,259	301,732	29,620	24,138
18	うち、内部モデル方式適用分	463,332	444,288	37,066	35,543
19	オペレーショナル・リスク	1,846,425	1,840,845	147,714	147,267
20	うち、基礎的手法適用分	-	-	-	-
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	875,965	833,026	72,136	68,668
	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)	52,021,556	50,488,405	4,161,724	4,039,072