

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9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9月末	2019年6月末	2019年9月末	2019年6月末
1	信用リスク	36,502,045	36,167,955	3,081,276	3,053,600
2	うち、標準的手法適用分	1,730,406	1,568,743	138,432	125,499
3	うち、内部格付手法適用分	33,565,152	33,367,470	2,846,324	2,829,561
	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	1,206,487	1,231,740	96,518	98,539
4	カウンターパーティ信用リスク	3,770,284	4,128,185	307,202	335,714
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	138,278	118,463	11,634	9,962
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	856,231	873,633	72,548	74,018
	うち、CVAリスク	2,036,868	2,365,202	162,949	189,216
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	130,974	158,699	10,477	12,695
	その他	607,932	612,187	49,591	49,821
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	1,828,413	2,011,704	155,049	170,592
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）	4,778,640	3,999,133	404,097	337,885
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%）	224,446	227,986	19,033	19,333
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%）	40,715	11,703	3,257	936
11	未決済取引	10,531	1,744	892	147
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	1,057,361	1,022,146	84,588	81,771
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	808,831	788,458	64,706	63,076
14	うち、外部格付準拠方式適用分	240,029	225,188	19,202	18,015
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	1,479,754	1,593,313	118,380	127,465
17	うち、標準的方式適用分	682,806	765,471	54,624	61,237
18	うち、内部モデル方式適用分	796,947	827,842	63,755	66,227
19	オペレーショナル・リスク	2,267,254	2,307,031	181,380	184,562
20	うち、基礎的手法適用分	478,911	460,605	38,312	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	1,788,342	1,846,425	143,067	147,714
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	1,011,018	1,033,142	83,570	85,291
	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)	55,484,108	54,966,252	4,438,728	4,397,300

(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	372,402	
2	当四半期中の要因別の変動額	資産の規模	△ 252
3		ポートフォリオの質	1,188
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	△ 795
8		その他	△ 390
9	当四半期末時点における信用リスク・アセットの額	372,152	

- 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9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	8,736	
2	当四半期中の要因別の変動額	資産の規模	△ 77
3		取引相手方の信用力	△ 47
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	△ 41
8		その他	△ 7
9		当四半期末時点における信用リスク・アセットの額	8,562

みずほ銀行【連結】
2019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	2,375	5,902	-	-		8,278	
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	2.94	3.81	-	-		3.52	
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	805	1,545	-	-		2,351	
2	当四半期中の 要因別の変動額	リスク量の変動	570	1,105	-	-		1,676
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	100	567	-	-		667
7		その他	256	43	-	-		299
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	1,018	2,041	-	-		3,060	
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	2.38	2.71	-	-		2.60	
8c	当四半期末におけるリスク・アセット	2,432	5,537	-	-		7,969	