

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	35,583,490	35,486,419	3,012,527	3,004,308
2	うち、標準的手法適用分	-	-	-	-
3	うち、内部格付手法適用分	34,551,775	34,457,293	2,929,990	2,921,978
	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	1,031,715	1,029,126	82,537	82,330
4	カウンターパーティ信用リスク	2,905,421	3,290,364	237,314	268,107
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	80,627	55,553	6,837	4,710
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	737,968	786,228	62,579	66,672
	うち、CVAリスク	1,794,156	2,154,522	143,532	172,361
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	94,430	119,461	7,554	9,556
	その他	198,238	174,598	16,810	14,805
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	1,587,410	1,760,515	134,612	149,291
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）	4,937,016	4,118,104	417,527	347,974
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%）	224,050	290,114	18,999	24,601
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	16,815	1,641	1,425	139
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	1,038,845	997,844	83,107	79,827
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	790,315	764,156	63,225	61,132
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	694,553	833,591	55,564	66,687
17	うち、標準的方式適用分	313,725	370,259	25,098	29,620
18	うち、内部モデル方式適用分	380,827	463,332	30,466	37,066
19	オペレーショナル・リスク	1,788,342	1,846,425	143,067	147,714
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	1,788,342	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	845,043	875,965	69,662	72,136
	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)	52,213,339	52,021,556	4,177,067	4,161,724