

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12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12月末	2019年9月末	2019年12月末	2019年9月末
1	信用リスク	37,566,856	36,502,045	3,170,596	3,081,276
2	うち、標準的手法適用分	1,778,498	1,730,406	142,279	138,432
3	うち、内部格付手法適用分	34,426,757	33,565,152	2,919,389	2,846,324
	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	1,361,600	1,206,487	108,928	96,518
4	カウンターパーティ信用リスク	3,626,638	3,770,284	295,813	307,202
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	145,719	138,278	12,262	11,634
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	836,530	856,231	70,914	72,548
	うち、CVAリスク	1,902,197	2,036,868	152,175	162,949
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	124,041	130,974	9,923	10,477
	その他	618,149	607,932	50,536	49,591
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	1,756,620	1,828,413	148,961	155,049
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）	5,811,284	4,778,640	491,438	404,097
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%）	319,588	224,446	27,101	19,033
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%）	99,029	40,715	7,922	3,257
11	未決済取引	11,599	10,531	983	892
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	1,059,906	1,057,361	84,792	84,588
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	813,401	808,831	65,072	64,706
14	うち、外部格付準拠方式適用分	238,004	240,029	19,040	19,202
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	1,857,333	1,479,754	148,586	118,380
17	うち、標準的方式適用分	774,622	682,806	61,969	54,624
18	うち、内部モデル方式適用分	1,082,710	796,947	86,616	63,755
19	オペレーショナル・リスク	2,269,083	2,267,254	181,526	181,380
20	うち、基礎的手法適用分	478,911	478,911	38,312	38,312
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	1,790,172	1,788,342	143,213	143,067
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	1,070,863	1,011,018	88,409	83,570
	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)	58,076,662	55,484,108	4,646,133	4,438,728

(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	372,152	
2	当四半期中の要因別の変動額	資産の規模	6,402
3		ポートフォリオの質	△ 294
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	2,917
8		その他	646
9	当四半期末時点における信用リスク・アセットの額	381,824	

- 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12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	8,562	
2	当四半期中の要因別の変動額	資産の規模	△ 429
3		取引相手方の信用力	63
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	158
8		その他	10
9	当四半期末時点における信用リスク・アセットの額	8,365	

みずほ銀行【連結】
2019年12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	2,432	5,537	-	-		7,969	
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	2.38	2.71	-	-		2.60	
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	1,018	2,041	-	-		3,060	
2	当四半期中の 要因別の変動額	リスク量の変動	△ 199	448	-	-		249
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	157	160	-	-		318
7		その他	△ 59	132	-	-		72
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	917	2,783	-	-		3,700	
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	3.41	2.76	-	-		2.92	
8c	当四半期末におけるリスク・アセット	3,130	7,697	-	-		10,827	