

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	36,572,025	35,583,490	3,095,622	3,012,527
2	うち、標準的手法適用分	-	-	-	-
3	うち、内部格付手法適用分	35,387,614	34,551,775	3,000,869	2,929,990
	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	1,184,410	1,031,715	94,752	82,537
4	カウンターパーティ信用リスク	2,652,675	2,905,421	216,897	237,314
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	67,765	80,627	5,746	6,837
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	682,731	737,968	57,895	62,579
	うち、CVAリスク	1,592,838	1,794,156	127,427	143,532
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	84,035	94,430	6,722	7,554
	その他	225,304	198,238	19,105	16,810
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	1,480,168	1,587,410	125,518	134,612
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）	5,982,334	4,937,016	505,944	417,527
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%）	318,693	224,050	27,025	18,999
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	11,555	16,815	979	1,425
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	1,024,993	1,038,845	81,999	83,107
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	778,488	790,315	62,279	63,225
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	812,918	694,553	65,033	55,564
17	うち、標準的方式適用分	301,403	313,725	24,112	25,098
18	うち、内部モデル方式適用分	511,515	380,827	40,921	30,466
19	オペレーショナル・リスク	1,790,172	1,788,342	143,213	143,067
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	1,790,172	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	869,415	845,043	71,601	69,662
	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)	54,271,980	52,213,339	4,341,758	4,177,067