

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】
2020年3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	
		2020年3月末	2019年12月末	2020年3月末	2019年12月末
1	信用リスク	37,313,531	37,566,856	3,149,118	3,170,596
2	うち、標準的手法適用分	1,799,001	1,778,498	143,920	142,279
3	うち、内部格付手法適用分	34,174,244	34,426,757	2,897,975	2,919,389
	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	1,340,285	1,361,600	107,222	108,928
4	カウンターパーティ信用リスク	3,978,506	3,626,638	325,122	295,813
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	127,405	145,719	10,689	12,262
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	1,114,918	836,530	94,434	70,914
	うち、CVAリスク	2,015,395	1,902,197	161,231	152,175
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	121,841	124,041	9,747	9,923
	その他	598,945	618,149	49,019	50,536
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	1,897,983	1,756,620	160,949	148,961
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）	4,892,919	5,811,284	413,690	491,438
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%）	180,938	319,588	15,343	27,101
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%）	82,927	99,029	6,634	7,922
11	未決済取引	16,897	11,599	1,423	983
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	991,463	1,059,906	79,317	84,792
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	795,531	813,401	63,642	65,072
14	うち、外部格付準拠方式適用分	187,432	238,004	14,994	19,040
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	1,498,965	1,857,333	119,917	148,586
17	うち、標準的方式適用分	526,391	774,622	42,111	61,969
18	うち、内部モデル方式適用分	972,574	1,082,710	77,805	86,616
19	オペレーショナル・リスク	2,353,353	2,269,083	188,268	181,526
20	うち、基礎的手法適用分	491,456	478,911	39,316	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	1,861,896	1,790,172	148,951	143,213
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	1,258,390	1,070,863	103,439	88,409
	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)	57,040,297	58,076,662	4,563,223	4,646,133

みずほ銀行【連結】
2020年3月末

(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	381,824	
2	当四半期中の要因別の変動額	資産の規模	2,965
3		ポートフォリオの質	973
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	△ 2,627
8		その他	△ 672
9	当四半期末時点における信用リスク・アセットの額	382,463	

- 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】
2020年3月末

(単位：億円)

CCR7：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	8,365	
2	当四半期中の要因別の変動額	資産の規模	3,073
3		取引相手方の信用力	△ 93
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	△ 183
8		その他	△ 12
9		当四半期末時点における信用リスク・アセットの額	11,149

みずほ銀行【連結】
2020年3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	3,130	7,697	-	-		10,827	
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	3.41	2.76	-	-		2.92	
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	917	2,783	-	-		3,700	
2	当四半期中の 要因別の変動額	リスク量の変動	△ 1,220	△ 1,135	-	-		△ 2,356
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	△ 10	△ 337	-	-		△ 347
7		その他	1,865	224	-	-		2,089
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	1,551	1,534	-	-		3,086	
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	2.12	4.19	-	-		3.15	
8c	当四半期末におけるリスク・アセット	3,293	6,432	-	-		9,725	