

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】
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	36,478,384	36,572,025	3,087,130	3,095,622
2	うち、標準的手法適用分	-	-	-	-
3	うち、内部格付手法適用分	35,179,123	35,387,614	2,983,189	3,000,869
	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	1,299,261	1,184,410	103,940	94,752
4	カウンターパーティ信用リスク	2,668,772	2,652,675	218,797	216,897
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	41,551	67,765	3,523	5,746
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	833,178	682,731	70,653	57,895
	うち、CVAリスク	1,491,081	1,592,838	119,286	127,427
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	74,359	84,035	5,948	6,722
	その他	228,599	225,304	19,385	19,105
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	1,599,750	1,480,168	135,658	125,518
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）	5,071,786	5,982,334	428,858	505,944
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%）	186,343	318,693	15,801	27,025
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	15,013	11,555	1,273	979
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	943,888	1,024,993	75,511	81,999
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	747,955	778,488	59,836	62,279
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	833,704	812,918	66,696	65,033
17	うち、標準的方式適用分	248,258	301,403	19,860	24,112
18	うち、内部モデル方式適用分	585,445	511,515	46,835	40,921
19	オペレーショナル・リスク	1,861,896	1,790,172	148,951	143,213
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	1,861,896	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	1,062,389	869,415	87,042	71,601
	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)	53,404,453	54,271,980	4,272,356	4,341,758