

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6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6月末	2020年3月末	2020年6月末	2020年3月末
1	信用リスク	39,316,709	37,313,531	3,319,367	3,149,118
2	うち、標準的手法適用分	1,774,680	1,799,001	141,974	143,920
3	うち、内部格付手法適用分	36,256,310	34,174,244	3,074,535	2,897,975
	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	1,285,717	1,340,285	102,857	107,222
4	カウンターパーティ信用リスク	3,678,343	3,978,506	300,532	325,122
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	130,609	127,405	10,916	10,689
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	1,066,986	1,114,918	90,385	94,434
	うち、CVAリスク	1,879,162	2,015,395	150,333	161,231
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	135,045	121,841	10,803	9,747
	その他	466,539	598,945	38,093	49,019
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	1,881,120	1,897,983	159,519	160,949
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）	5,555,821	4,892,919	469,980	413,690
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%）	356,880	180,938	30,263	15,343
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%）	83,929	82,927	6,714	6,634
11	未決済取引	2,260	16,897	191	1,423
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	980,038	991,463	78,403	79,317
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	786,558	795,531	62,924	63,642
14	うち、外部格付準拠方式適用分	193,480	187,432	15,478	14,994
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	-	680
16	マーケット・リスク	1,898,690	1,498,965	151,895	119,917
17	うち、標準的方式適用分	475,055	526,391	38,004	42,111
18	うち、内部モデル方式適用分	1,423,634	972,574	113,890	77,805
19	オペレーショナル・リスク	2,357,372	2,353,353	188,589	188,268
20	うち、基礎的手法適用分	491,456	491,456	39,316	39,316
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	1,865,915	1,861,896	149,273	148,951
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	1,183,243	1,258,390	97,420	103,439
	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)	60,035,956	57,040,297	4,802,876	4,563,223

みずほ銀行【連結】
2020年6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	382,463	
2	当四半期中の要因別の変動額	資産の規模	12,864
3		ポートフォリオの質	7,135
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	△ 151
8		その他	179
9	当四半期末時点における信用リスク・アセットの額	402,490	

- 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6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	11,149	
2	当四半期中の要因別の変動額	資産の規模	△ 551
3		取引相手方の信用力	102
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	△ 34
8		その他	4
9	当四半期末時点における信用リスク・アセットの額	10,669	

みずほ銀行【連結】
2020年6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	3,293	6,432	-	-		9,725	
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	2.12	4.19	-	-		3.15	
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	1,551	1,534	-	-		3,086	
2	当四半期中の 要因別の変動額	リスク量の変動	31	209	-	-		240
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	294	△ 229	-	-		64
7		その他	△ 398	1,244	-	-		846
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	1,479	2,758	-	-		4,237	
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	3.57	3.24	-	-		3.35	
8c	当四半期末におけるリスク・アセット	5,295	8,940	-	-		14,236	