

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9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9月末	2020年6月末	2020年9月末	2020年6月末
1	信用リスク	39,557,684	39,316,709	3,339,250	3,319,367
2	うち、標準的手法適用分	1,862,331	1,774,680	148,986	141,974
3	うち、内部格付手法適用分	36,382,433	36,256,310	3,085,230	3,074,535
	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	1,312,919	1,285,717	105,033	102,857
4	カウンターパーティ信用リスク	3,668,335	3,678,343	299,779	300,532
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	164,280	130,609	13,816	10,916
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	1,054,579	1,066,986	89,312	90,385
	うち、CVAリスク	1,863,097	1,879,162	149,047	150,333
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	132,066	135,045	10,565	10,803
	その他	454,311	466,539	37,037	38,093
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	1,644,503	1,881,120	139,453	159,519
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）	5,753,805	5,555,821	486,630	469,980
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%）	214,352	356,880	18,177	30,263
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%）	123,699	83,929	9,895	6,714
11	未決済取引	652	2,260	55	191
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	962,436	980,038	76,994	78,403
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	768,191	786,558	61,455	62,924
14	うち、外部格付準拠方式適用分	194,245	193,480	15,539	15,478
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	-	-	-	-
16	マーケット・リスク	1,678,931	1,898,690	134,314	151,895
17	うち、標準的方式適用分	538,620	475,055	43,089	38,004
18	うち、内部モデル方式適用分	1,140,311	1,423,634	91,224	113,890
19	オペレーショナル・リスク	2,293,254	2,357,372	183,460	188,589
20	うち、基礎的手法適用分	524,090	491,456	41,927	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	1,769,163	1,865,915	141,533	149,273
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	1,113,988	1,183,243	91,927	97,420
	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）	59,749,250	60,035,956	4,779,940	4,802,876

みずほ銀行【連結】
2020年9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	402,490	
2	当四半期中の要因別の変動額	資産の規模	△ 7,047
3		ポートフォリオの質	6,272
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	△ 1,052
8		その他	29
9	当四半期末時点における信用リスク・アセットの額	400,692	

- 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9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	10,669	
2	当四半期中の要因別の変動額	資産の規模	△ 117
3		取引相手方の信用力	65
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	△ 77
8		その他	5
9	当四半期末時点における信用リスク・アセットの額	10,545	

みずほ銀行【連結】
2020年9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	5,295	8,940	-	-		14,236	
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	3.57	3.24	-	-		3.35	
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	1,479	2,758	-	-		4,237	
2	当四半期中の 要因別の変動額	リスク量の変動	△ 465	△ 301	-	-		△ 767
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	△ 79	△ 197	-	-		△ 276
7		その他	△ 44	35	-	-		△ 8
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	889	2,294	-	-		3,184	
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	3.79	3.49	-	-		3.58	
8c	当四半期末におけるリスク・アセット	3,377	8,025	-	-		11,403	