

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	38,706,719	38,635,147	3,276,179	3,270,007
2	うち、標準的手法適用分	-	-	-	-
3	うち、内部格付手法適用分	37,425,356	37,332,454	3,173,670	3,165,792
	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	1,281,362	1,302,693	102,509	104,215
4	カウンターパーティ信用リスク	2,453,798	2,377,093	201,224	194,899
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	87,052	37,021	7,382	3,139
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	800,188	791,553	67,855	67,123
	うち、CVAリスク	1,355,805	1,310,350	108,464	104,828
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	72,835	80,971	5,826	6,477
	その他	137,916	157,196	11,695	13,330
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	1,367,075	1,598,137	115,927	135,522
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）	5,948,628	5,736,719	503,151	485,320
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%）	233,161	402,885	19,772	34,164
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	607	2,176	51	184
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	917,878	952,333	73,430	76,186
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	723,633	758,852	57,890	60,708
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	916,277	1,274,566	73,302	101,965
17	うち、標準的方式適用分	230,282	165,354	18,422	13,228
18	うち、内部モデル方式適用分	685,995	1,109,212	54,879	88,736
19	オペレーショナル・リスク	1,769,163	1,865,915	141,533	149,273
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	1,769,163	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	910,332	996,540	74,843	81,774
	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)	56,116,404	56,700,160	4,489,312	4,536,012