

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12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12月末	2020年9月末	2020年12月末	2020年9月末
1	信用リスク	39,414,771	39,557,684	3,327,459	3,339,250
2	うち、標準的手法適用分	1,806,706	1,862,331	144,536	148,986
3	うち、内部格付手法適用分	36,307,855	36,382,433	3,078,906	3,085,230
	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	1,300,209	1,312,919	104,016	105,033
4	カウンターパーティ信用リスク	3,449,631	3,668,335	282,336	299,779
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	144,634	164,280	12,151	13,816
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	1,036,977	1,054,579	87,830	89,312
	うち、CVAリスク	1,654,665	1,863,097	132,373	149,047
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	140,495	132,066	11,239	10,565
	その他	472,858	454,311	38,741	37,037
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	2,774,348	1,644,503	235,264	139,453
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）	6,277,125	5,753,805	531,148	486,630
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%）	211,373	214,352	17,924	18,177
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%）	196,594	123,699	15,727	9,895
11	未決済取引	2,216	652	187	55
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	1,004,601	962,436	80,368	76,994
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	811,344	768,191	64,907	61,455
14	うち、外部格付準拠方式適用分	193,024	194,245	15,441	15,539
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	232	-	18	-
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	-	-	-	-
16	マーケット・リスク	1,703,363	1,678,931	136,269	134,314
17	うち、標準的方式適用分	619,264	538,620	49,541	43,089
18	うち、内部モデル方式適用分	1,084,098	1,140,311	86,727	91,224
19	オペレーショナル・リスク	2,292,595	2,293,254	183,407	183,460
20	うち、基礎的手法適用分	524,090	524,090	41,927	41,927
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	1,768,505	1,769,163	141,480	141,533
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	1,062,026	1,113,988	87,839	91,927
	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)	61,224,169	59,749,250	4,897,933	4,779,940

みずほ銀行【連結】
2020年12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	400,692	
2	当四半期中の要因別の変動額	資産の規模	8,876
3		ポートフォリオの質	2,105
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	△ 969
8		その他	149
9		当四半期末時点における信用リスク・アセットの額	410,855

- 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12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	10,545	
2	当四半期中の要因別の変動額	資産の規模	△ 196
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	△ 80
8		その他	8
9		当四半期末時点における信用リスク・アセットの額	10,369

(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	3,377	8,025	-	-		11,403	
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	3.79	3.49	-	-		3.58	
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	889	2,294	-	-		3,184	
2	当四半期中の 要因別の変動額	リスク量の変動	119	48	-	-		167
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	13	△ 129	-	-		△ 116
7		その他	△ 77	△ 42	-	-		△ 120
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	945	2,170	-	-		3,115	
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	3.45	3.49	-	-		3.47	
8c	当四半期末におけるリスク・アセット	3,262	7,578	-	-		10,840	