

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	38,629,941	38,706,719	3,269,545	3,276,179
2	うち、標準的手法適用分	-	-	-	-
3	うち、内部格付手法適用分	37,322,967	37,425,356	3,164,987	3,173,670
	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	1,306,974	1,281,362	104,557	102,509
4	カウンターパーティ信用リスク	2,358,809	2,453,798	193,675	201,224
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	51,303	87,052	4,350	7,382
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	796,489	800,188	67,542	67,855
	うち、CVAリスク	1,254,196	1,355,805	100,335	108,464
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	68,944	72,835	5,515	5,826
	その他	187,874	137,916	15,931	11,695
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	2,501,139	1,367,075	212,096	115,927
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）	6,457,594	5,948,628	546,452	503,151
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%）	238,183	233,161	20,197	19,772
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	2,189	607	185	51
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	962,547	917,878	77,003	73,430
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	769,290	723,633	61,543	57,890
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	1,049,519	916,277	83,961	73,302
17	うち、標準的方式適用分	328,422	230,282	26,273	18,422
18	うち、内部モデル方式適用分	721,096	685,995	57,687	54,879
19	オペレーショナル・リスク	1,768,505	1,769,163	141,480	141,533
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	1,768,505	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	843,685	910,332	69,526	74,843
	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）	57,873,185	56,116,404	4,629,854	4,489,312