

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】
2021年3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	
		2021年3月末	2020年12月末	2021年3月末	2020年12月末
1	信用リスク	40,473,971	39,414,771	3,417,529	3,327,459
2	うち、標準的手法適用分	1,686,497	1,806,706	134,919	144,536
3	うち、内部格付手法適用分	37,419,052	36,307,855	3,173,135	3,078,906
	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	1,386,634	1,300,209	110,930	104,016
4	カウンターパーティ信用リスク	3,798,638	3,449,631	310,897	282,336
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	400,030	144,634	33,743	12,151
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	968,218	1,036,977	82,009	87,830
	うち、CVAリスク	1,847,913	1,654,665	147,833	132,373
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	125,255	140,495	10,020	11,239
	その他	457,220	472,858	37,291	38,741
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	3,175,969	2,774,348	269,322	235,264
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）	5,912,649	6,277,125	500,390	531,148
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%）	239,760	211,373	20,331	17,924
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%）	146,371	196,594	11,727	15,727
11	未決済取引	2,186	2,216	185	187
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	1,103,642	1,004,601	88,291	80,368
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	920,899	811,344	73,671	64,907
14	うち、外部格付準拠方式適用分	182,493	193,024	14,599	15,441
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	249	232	19	18
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	-	-	-	-
16	マーケット・リスク	1,593,951	1,703,363	127,516	136,269
17	うち、標準的方式適用分	597,832	619,264	47,826	49,541
18	うち、内部モデル方式適用分	996,118	1,084,098	79,689	86,727
19	オペレーショナル・リスク	2,260,100	2,292,595	180,808	183,407
20	うち、基礎的手法適用分	527,479	524,090	42,198	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	1,732,621	1,768,505	138,609	141,480
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	1,108,604	1,062,026	91,725	87,839
	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)	62,734,067	61,224,169	5,018,725	4,897,933

(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	410,898	
2	当四半期中の要因別の変動額	資産の規模	2,619
3		ポートフォリオの質	4,379
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	7,993
8		その他	631
9	当四半期末時点における信用リスク・アセットの額	426,522	

- 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】
2021年3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	10,369	
2	当四半期中の要因別の変動額	資産の規模	△ 1,230
3		取引相手方の信用力	76
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	457
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	9,682

みずほ銀行【連結】
2021年3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	3,262	7,578	-	-		10,840	
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	3.45	3.49	-	-		3.47	
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	945	2,170	-	-		3,115	
2	当四半期中の 要因別の変動額	リスク量の変動	△ 48	△ 822	-	-		△ 870
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	△ 292	△ 171	-	-		△ 463
7		その他	150	1,278	-	-		1,428
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	754	2,454	-	-		3,209	
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	3.24	3.06	-	-		3.10	
8c	当四半期末におけるリスク・アセット	2,447	7,513	-	-		9,961	