

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】
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	39,690,512	38,629,941	3,359,392	3,269,545
2	うち、標準的手法適用分	-	-	-	-
3	うち、内部格付手法適用分	38,364,975	37,322,967	3,253,349	3,164,987
	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	1,325,537	1,306,974	106,042	104,557
4	カウンターパーティ信用リスク	2,369,841	2,358,809	195,100	193,675
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	241,749	51,303	20,500	4,350
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	760,108	796,489	64,457	67,542
	うち、CVAリスク	1,141,297	1,254,196	91,303	100,335
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	79,966	68,944	6,397	5,515
	その他	146,719	187,874	12,441	15,931
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	2,877,948	2,501,139	244,050	212,096
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）	6,132,234	6,457,594	519,011	546,452
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%）	238,730	238,183	20,244	20,197
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	2,140	2,189	181	185
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	1,075,824	962,547	86,065	77,003
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	893,081	769,290	71,446	61,543
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	790,121	1,049,519	63,209	83,961
17	うち、標準的方式適用分	274,822	328,422	21,985	26,273
18	うち、内部モデル方式適用分	515,299	721,096	41,223	57,687
19	オペレーショナル・リスク	1,732,621	1,768,505	138,609	141,480
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	1,732,621	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	857,696	843,685	70,690	69,526
	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）	58,853,549	57,873,185	4,708,283	4,629,854