

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6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6月末	2021年3月末	2021年6月末	2021年3月末
1	信用リスク	39,957,024	40,473,971	3,373,483	3,417,529
2	うち、標準的手法適用分	1,690,009	1,686,497	135,200	134,919
3	うち、内部格付手法適用分	36,858,635	37,419,052	3,125,612	3,173,135
	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	1,408,380	1,386,634	112,670	110,930
4	カウンターパーティ信用リスク	3,466,296	3,798,638	283,453	310,897
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	138,425	400,030	11,631	33,743
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	1,040,306	968,218	88,105	82,009
	うち、CVAリスク	1,721,682	1,847,913	137,734	147,833
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	138,828	125,255	11,106	10,020
	その他	427,053	457,220	34,876	37,291
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	3,987,702	3,175,969	338,157	269,322
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）	5,949,717	5,912,649	503,533	500,390
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%）	183,042	239,760	15,522	20,331
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%）	220,574	146,371	17,646	11,727
11	未決済取引	2,548	2,186	215	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	1,045,265	1,103,642	83,621	88,291
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	876,679	920,899	70,134	73,671
14	うち、外部格付準拠方式適用分	168,352	182,493	13,468	14,599
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	233	249	18	19
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	0	0	0	0
16	マーケット・リスク	1,448,932	1,593,951	115,914	127,516
17	うち、標準的方式適用分	686,364	597,832	54,909	47,826
18	うち、内部モデル方式適用分	762,567	996,118	61,005	79,689
19	オペレーショナル・リスク	2,262,845	2,260,100	181,027	180,808
20	うち、基礎的手法適用分	527,479	527,479	42,198	42,198
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	1,735,365	1,732,621	138,829	138,609
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	1,079,994	1,108,604	89,637	91,725
	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）	62,527,663	62,734,067	5,002,213	5,018,725

みずほ銀行【連結】
2021年6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	426,522	
2	当四半期中の要因別の変動額	資産の規模	1,133
3		ポートフォリオの質	996
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	175
8		その他	78
9		当四半期末時点における信用リスク・アセットの額	428,906

- 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6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	9,682	
2	当四半期中の要因別の変動額	資産の規模	746
3		取引相手方の信用力	△ 30
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	3
8		その他	-
9		当四半期末時点における信用リスク・アセットの額	10,403

みずほ銀行【連結】
2021年6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	2,447	7,513	-	-		9,961	
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	3.24	3.06	-	-		3.10	
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	754	2,454	-	-		3,209	
2	当四半期中の 要因別の変動額	リスク量の変動	△ 501	△ 722	-	-		△ 1,223
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	25	1	-	-		26
7		その他	522	13	-	-		536
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	802	1,746	-	-		2,548	
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	3.20	2.89	-	-		2.99	
8c	当四半期末におけるリスク・アセット	2,572	5,052	-	-		7,625	