

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	39,219,381	39,690,512	3,319,312	3,359,392
2	うち、標準的手法適用分	-	-	-	-
3	うち、内部格付手法適用分	37,867,029	38,364,975	3,211,124	3,253,349
	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	1,352,352	1,325,537	108,188	106,042
4	カウンターパーティ信用リスク	2,322,679	2,369,841	190,447	195,100
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	31,338	241,749	2,657	20,500
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	787,194	760,108	66,754	64,457
	うち、CVAリスク	1,282,684	1,141,297	102,614	91,303
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	74,771	79,966	5,981	6,397
	その他	146,690	146,719	12,439	12,441
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	3,667,766	2,877,948	311,026	244,050
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）	6,177,254	6,132,234	522,829	519,011
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%）	198,815	238,730	16,859	20,244
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	2,517	2,140	213	181
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	1,022,986	1,075,824	81,838	86,065
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	854,400	893,081	68,352	71,446
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	819,413	790,121	65,553	63,209
17	うち、標準的方式適用分	256,201	274,822	20,496	21,985
18	うち、内部モデル方式適用分	563,212	515,299	45,056	41,223
19	オペレーショナル・リスク	1,735,365	1,732,621	138,829	138,609
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	1,735,365	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	794,183	857,696	65,630	70,690
	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）	59,127,328	58,853,549	4,730,186	4,708,283