

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9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9月末	2021年6月末	2021年9月末	2021年6月末
1	信用リスク	39,295,217	39,219,381	3,326,329	3,319,312
2	うち、標準的手法適用分	-	-	-	-
3	うち、内部格付手法適用分	38,065,114	37,867,029	3,227,921	3,211,124
	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	1,230,103	1,352,352	98,408	108,188
4	カウンターパーティ信用リスク	2,123,700	2,322,679	174,245	190,447
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	32,609	31,338	2,765	2,657
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	746,075	787,194	63,267	66,754
	うち、CVAリスク	1,152,129	1,282,684	92,170	102,614
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	65,379	74,771	5,230	5,981
	その他	127,506	146,690	10,812	12,439
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	3,473,820	3,667,766	294,579	311,026
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）	5,703,053	6,177,254	482,654	522,829
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%）	140,669	198,815	11,928	16,859
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%）	253,839	220,574	20,317	17,646
11	未決済取引	19,339	2,517	1,639	213
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	994,656	1,022,986	79,572	81,838
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	839,060	854,400	67,124	68,352
14	うち、外部格付準拠方式適用分	155,345	168,352	12,427	13,468
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	251	233	20	18
	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	787,158	819,413	62,972	65,553
17	うち、標準的方式適用分	258,386	256,201	20,670	20,496
18	うち、内部モデル方式適用分	528,772	563,212	42,301	45,056
19	オペレーショナル・リスク	1,729,757	1,735,365	138,380	138,829
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	1,729,757	1,735,365	138,380	138,829
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	770,038	794,183	63,709	65,630
	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(スケールリング・ファクター勘案後)	58,204,140	59,127,328	4,656,331	4,730,186