

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

みずほフィナンシャルグループ【連結】
平成30年6月末

(単位：百万円)

0V1：リスク・アセットの概要					
国際様式の該当番号		イ	ロ	ハ	ニ
		リスク・アセット		所要自己資本	
		平成30年6月末	平成30年3月末	平成30年6月末	平成30年3月末
1	信用リスク	39,338,597	38,823,030	3,318,654	3,275,858
2	うち、標準的手法適用分	1,937,143	1,820,063	154,971	145,605
3	うち、内部格付手法適用分	35,742,984	35,420,038	3,031,005	3,003,619
	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	1,658,469	1,582,929	132,677	126,634
4	カウンターパーティ信用リスク	4,234,611	4,531,171	343,046	366,994
5	うち、S A C C R 適用分	-	-	-	-
	うち、カレント・エクスポージャー方式適用分	232,229	216,424	19,080	17,723
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	791,471	887,843	66,545	74,632
	うち、C V A リスク	2,304,524	2,539,780	184,361	203,182
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	195,688	193,088	15,655	15,447
	その他	710,697	694,035	57,402	56,009
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	3,298,965	2,972,073	279,752	252,031
	複数の資産及び取引を裏付けとするエクスポージャー	-	-	-	-
	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	3,829,613	3,515,582	323,920	297,289
11	未決済取引	3,694	4,574	312	386
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	380,754	379,016	32,137	32,003
13	うち、内部格付手法における外部格付準拠方式又は内部評価方式適用分	113,793	110,551	9,649	9,374
14	うち、内部格付手法における指定関数方式適用分	227,130	231,492	19,260	19,630
15	うち、標準的手法適用分	28,892	25,711	2,311	2,056
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	10,938	11,261	915	941
16	マーケット・リスク	2,279,781	2,470,321	182,382	197,625
17	うち、標準的方式適用分	1,365,028	1,406,398	109,202	112,511
18	うち、内部モデル方式適用分	914,753	1,063,922	73,180	85,113
19	オペレーショナル・リスク	3,415,280	3,411,289	273,222	272,903
20	うち、基礎的手法適用分	591,083	591,083	47,286	47,286
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	2,824,197	2,820,206	225,935	225,616
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	718,964	818,950	59,211	67,224
	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)	60,157,998	59,528,983	4,812,639	4,762,318

みずほフィナンシャルグループ【連結】
平成30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	400,088	
2	当四半期中の要因別の変動額	資産の規模	3,483
3		ポートフォリオの質	△ 848
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	3,008
8		その他	40
9	当四半期末時点における信用リスク・アセットの額	405,773	

- 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. 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。

みずほフィナンシャルグループ【連結】
平成30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	8,878	
2	当四半期中の要因別の変動額	資産の規模	△ 1,042
3		取引相手方の信用力	△ 27
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	94
8		その他	11
9	当四半期末時点における信用リスク・アセットの額	7,914	

みずほフィナンシャルグループ【連結】
平成30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
		バリュエーション・リスク	ストレステスト・バリュエーション・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	2,690	7,948	-	-		10,639
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	3.02	3.72	-	-		3.51
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	890	2,136	-	-		3,026
2	当四半期中の 要因別の変動額	リスク量の変動	△ 223	141	-	-	△ 81
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	346	308	-	-	655
7		その他	△ 276	△ 157	-	-	△ 433
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	737	2,429	-	-		3,166
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	3.16	2.80	-	-		2.88
8c	当四半期末におけるリスク・アセット	2,335	6,811	-	-		9,147