

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9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9月末	平成30年6月末	平成30年9月末	平成30年6月末
1	信用リスク	39,321,500	39,338,597	3,318,738	3,318,654
2	うち、標準的手法適用分	1,746,997	1,937,143	139,759	154,971
3	うち、内部格付手法適用分	36,045,504	35,742,984	3,056,658	3,031,005
	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	1,528,998	1,658,469	122,319	132,677
4	カウンターパーティ信用リスク	4,224,033	4,234,611	342,012	343,046
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	191,124	232,229	15,676	19,080
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	785,753	791,471	65,991	66,545
	うち、C V A リスク	2,217,316	2,304,524	177,385	184,361
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	209,223	195,688	16,737	15,655
	その他	820,615	710,697	66,221	57,402
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	2,933,478	3,298,965	248,758	279,752
	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	3,502,698	3,829,613	296,200	323,920
11	未決済取引	6,530	3,694	552	312
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	441,369	380,754	37,270	32,137
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	116,430	113,793	9,873	9,649
14	うち、内部格付手法における指定関数方式適用分	283,679	227,130	24,056	19,260
15	うち、標準的手法適用分	30,262	28,892	2,421	2,311
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	10,996	10,938	920	915
16	マーケット・リスク	2,939,149	2,279,781	235,131	182,382
17	うち、標準的方式適用分	1,567,039	1,365,028	125,363	109,202
18	うち、内部モデル方式適用分	1,372,110	914,753	109,768	73,180
19	オペレーショナル・リスク	3,285,870	3,415,280	262,869	273,222
20	うち、基礎的手法適用分	608,277	591,083	48,662	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	2,677,592	2,824,197	214,207	225,935
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	946,938	718,964	77,668	59,211
	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)	60,240,051	60,157,998	4,819,204	4,812,639

みずほフィナンシャルグループ【連結】
平成30年9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	405,773	
2	当四半期中の要因別の変動額	資産の規模	1,680
3		ポートフォリオの質	4,149
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	3,570
8		その他	386
9	当四半期末時点における信用リスク・アセットの額	407,261	

- 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9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	7,914	
2	当四半期中の要因別の 変動額	資産の規模	181
3		取引相手方の信用力	11
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	129
8		その他	5
9	当四半期末時点における信用リスク・アセットの額	7,857	

みずほフィナンシャルグループ【連結】
平成30年9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・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	2,335	6,811	-	-		9,147	
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	3.16	2.80	-	-		2.88	
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	737	2,429	-	-		3,166	
2	当四半期中の 要因別の変動額	リスク量の変動	186	1,486	-	-		1,672
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	292	308	-	-		600
7		その他	6	△ 721	-	-		△ 714
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	1,222	3,503	-	-		4,725	
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	2.72	2.96	-	-		2.90	
8c	当四半期末におけるリスク・アセット	3,335	10,385	-	-		13,721	