

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】
2018年12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	
		2018年12月末	2018年9月末	2018年12月末	2018年9月末
1	信用リスク	39,215,597	39,321,500	3,309,118	3,318,738
2	うち、標準的手法適用分	1,721,655	1,746,997	137,732	139,759
3	うち、内部格付手法適用分	35,806,473	36,045,504	3,036,388	3,056,658
	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	1,687,467	1,528,998	134,997	122,319
4	カウンターパーティ信用リスク	4,489,683	4,224,033	364,067	342,012
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	257,310	191,124	21,161	15,676
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	835,275	785,753	70,231	65,991
	うち、C V A リスク	2,370,996	2,217,316	189,679	177,385
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	271,731	209,223	21,738	16,737
	その他	754,368	820,615	61,257	66,221
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	3,578,732	2,933,478	303,476	248,758
	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	3,951,401	3,502,698	334,252	296,200
11	未決済取引	23,652	6,530	2,004	552
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	437,902	441,369	36,976	37,270
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	99,464	116,430	8,434	9,873
14	うち、内部格付手法における指定関数方式適用分	297,075	283,679	25,191	24,056
15	うち、標準的手法適用分	30,426	30,262	2,434	2,421
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	10,935	10,996	915	920
16	マーケット・リスク	2,734,656	2,939,149	218,772	235,131
17	うち、標準的方式適用分	1,452,778	1,567,039	116,222	125,363
18	うち、内部モデル方式適用分	1,281,877	1,372,110	102,550	109,768
19	オペレーショナル・リスク	3,263,694	3,285,870	261,095	262,869
20	うち、基礎的手法適用分	608,277	608,277	48,662	48,662
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	2,655,416	2,677,592	212,433	214,207
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	1,254,003	946,938	102,676	77,668
	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)	61,655,523	60,240,051	4,932,441	4,819,204

みずほフィナンシャルグループ【連結】
2018年12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	407,261	
2	当四半期中の要因別の変動額	資産の規模	10,476
3		ポートフォリオの質	1,374
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	3,867
8		その他	495
9	当四半期末時点における信用リスク・アセットの額	414,750	

- 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】
2018年12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	7,857	
2	当四半期中の要因別の 変動額	資産の規模	712
3		取引相手方の信用力	55
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	158
8		その他	2
9	当四半期末時点における信用リスク・アセットの額	8,352	

みずほフィナンシャルグループ【連結】
2018年12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	3,335	10,385	-	-		13,721	
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	2.72	2.96	-	-		2.90	
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	1,222	3,503	-	-		4,725	
2	当四半期中の 要因別の変動額	リスク量の変動	△ 302	△ 847	-	-		△ 1,149
3		モデルの更新又は変更	57	92	-	-		149
4		手法及び方針	-	-	-	-		-
5		買収及び売却	-	-	-	-		-
6		為替の変動	△ 74	234	-	-		160
7		その他	116	△ 871	-	-		△ 755
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	1,019	2,110	-	-		3,130	
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	3.63	4.31	-	-		4.09	
8c	当四半期末におけるリスク・アセット	3,708	9,110	-	-		12,818	