

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】
2019年3月末

(単位：百万円)

OV1: 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	
		2019年3月末	2018年12月末	2019年3月末	2018年12月末
1	信用リスク	37,656,623	39,215,597	3,177,419	3,309,118
2	うち、標準的手法適用分	1,738,523	1,721,655	139,081	137,732
3	うち、内部格付手法適用分	34,352,032	35,806,473	2,913,052	3,036,388
	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	1,566,067	1,687,467	125,285	134,997
4	カウンターパーティ信用リスク	4,491,743	4,489,683	364,208	364,067
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	139,720	257,310	11,518	21,161
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	878,845	835,275	73,961	70,231
	うち、CVAリスク	2,457,535	2,370,996	196,602	189,679
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	190,997	271,731	15,279	21,738
	その他	824,644	754,368	66,846	61,257
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	2,492,949	3,578,732	211,402	303,476
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）	2,620,615	-	220,993	-
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%）	598,267	-	50,733	-
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%）	19,489	-	1,563	-
	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	-	334,252
11	未決済取引	2,705	23,652	229	2,004
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	1,050,204	437,902	84,016	36,976
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	735,081	-	58,806	-
14	うち、外部格付準拠方式適用分	304,189	-	24,335	-
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	-	-	-	-
	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	-	8,434
	うち、内部格付手法における指定関数方式適用分	-	297,075	-	25,191
	うち、標準的手法適用分	-	30,426	-	2,434
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	10,933	10,935	874	915
16	マーケット・リスク	2,034,213	2,734,656	162,737	218,772
17	うち、標準的方式適用分	1,172,343	1,452,778	93,787	116,222
18	うち、内部モデル方式適用分	861,870	1,281,877	68,949	102,550
19	オペレーショナル・リスク	3,236,495	3,263,694	258,919	261,095
20	うち、基礎的手法適用分	628,110	608,277	50,248	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	2,608,385	2,655,416	208,670	212,433
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	1,209,277	1,254,003	99,743	102,676
	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)	57,899,567	61,655,523	4,631,965	4,932,441

みずほフィナンシャルグループ【連結】
2019年3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	414,750	
2	当四半期中の要因別の変動額	資産の規模	△ 8,323
3		ポートフォリオの質	△ 16,557
4		モデルの更新	-
5		手法及び方針	△ 2,241
6		買収又は売却	-
7		為替の変動	145
8		その他	61
9	当四半期末時点における信用リスク・アセットの額	387,835	

- 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. 手法及び方針は、当局による規制の変更による計算手法の変更に起因するリスク・アセットの変動額です。
5. 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】
2019年3月末

(単位：億円)

GCR7：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	8,352	
2	当四半期中の要因別の変動額	資産の規模	863
3		取引相手方の信用力	△ 444
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	19
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	8,788

みずほフィナンシャルグループ【連結】
2019年3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		イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ	
項番		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	3,708	9,110	-	-		12,818	
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	3.63	4.31	-	-		4.09	
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	1,019	2,110	-	-		3,130	
2	当四半期中の要因別の変動額	リスク量の変動	△ 297	△ 27	-	-		△ 324
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	40	△ 26	-	-		13
7		その他	△ 102	123	-	-		20
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	660	2,179	-	-		2,839	
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	3.92	2.76	-	-		3.03	
8c	当四半期末におけるリスク・アセット	2,590	6,028	-	-		8,618	