

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	
		2019年9月末	2019年6月末	2019年9月末	2019年6月末
1	信用リスク	37,679,332	37,389,440	3,179,176	3,155,177
2	うち、標準的手法適用分	1,864,650	1,722,759	149,172	137,820
3	うち、内部格付手法適用分	34,339,462	34,171,240	2,911,986	2,897,721
	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	1,475,219	1,495,439	118,017	119,635
4	カウンターパーティ信用リスク	4,329,983	4,692,152	351,899	380,771
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	181,060	165,115	15,040	13,675
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	954,725	970,332	80,379	81,719
	うち、CVAリスク	2,199,578	2,532,198	175,966	202,575
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	172,278	197,011	13,782	15,760
	その他	822,340	827,492	66,730	67,039
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	2,398,440	2,525,019	203,387	214,121
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）	4,963,852	4,191,419	419,765	354,153
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%）	588,585	563,835	49,912	47,813
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%）	49,992	20,333	3,999	1,626
11	未決済取引	10,548	1,729	894	146
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	1,128,220	1,103,973	90,257	88,317
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	812,188	791,834	64,975	63,346
14	うち、外部格付準拠方式適用分	307,184	301,295	24,574	24,103
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	-	-	-	-
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	8,847	10,843	707	867
16	マーケット・リスク	2,377,608	2,356,875	190,208	188,550
17	うち、標準的方式適用分	1,458,998	1,447,104	116,719	115,768
18	うち、内部モデル方式適用分	918,610	909,770	73,488	72,781
19	オペレーショナル・リスク	3,201,774	3,240,370	256,141	259,229
20	うち、基礎的手法適用分	647,827	628,110	51,826	50,248
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	2,553,946	2,612,259	204,315	208,980
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	1,239,667	1,266,558	102,287	104,387
	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)	60,599,128	59,928,686	4,847,930	4,794,294

みずほフィナンシャルグループ【連結】  
2019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	386,965	
2	当四半期中の要因別の変動額	資産の規模	△ 332
3		ポートフォリオの質	1,501
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	△ 790
8		その他	△ 397
9	当四半期末時点における信用リスク・アセットの額	386,946	

- 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9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	9,703	
2	当四半期中の要因別の変動額	資産の規模	△ 59
3		取引相手方の信用力	△ 47
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	△ 41
8		その他	△ 7
9		当四半期末時点における信用リスク・アセットの額	9,547

みずほフィナンシャルグループ【連結】  
2019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	2,428	6,669	-	-		9,097	
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	2.87	3.52	-	-		3.32	
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	844	1,891	-	-		2,736	
2	当四半期中の 要因別の変動額	リスク量の変動	251	581	-	-		833
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	△ 203	△ 47	-	-		△ 251
7		その他	135	93	-	-		228
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	1,027	2,519	-	-		3,546	
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	2.26	2.72	-	-		2.59	
8c	当四半期末におけるリスク・アセット	2,329	6,856	-	-		9,186	