

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12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12月末	2019年9月末	2019年12月末	2019年9月末
1	信用リスク	38,630,551	37,679,332	3,259,411	3,179,176
2	うち、標準的手法適用分	1,919,904	1,864,650	153,592	149,172
3	うち、内部格付手法適用分	35,201,439	34,339,462	2,985,082	2,911,986
	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	1,509,207	1,475,219	120,736	118,017
4	カウンターパーティ信用リスク	4,274,504	4,329,983	347,576	351,899
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	201,219	181,060	16,684	15,040
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	934,123	954,725	78,672	80,379
	うち、CVAリスク	2,076,626	2,199,578	166,130	175,966
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	178,262	172,278	14,261	13,782
	その他	884,272	822,340	71,827	66,730
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	2,424,641	2,398,440	205,609	203,387
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）	6,035,392	4,963,852	510,403	419,765
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%）	697,769	588,585	59,170	49,912
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%）	108,461	49,992	8,676	3,999
11	未決済取引	11,632	10,548	986	894
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	1,120,667	1,128,220	89,653	90,257
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	816,737	812,188	65,339	64,975
14	うち、外部格付準拠方式適用分	295,079	307,184	23,606	24,574
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	8,850	8,847	708	707
16	マーケット・リスク	2,679,806	2,377,608	214,384	190,208
17	うち、標準的方式適用分	1,438,324	1,458,998	115,065	116,719
18	うち、内部モデル方式適用分	1,241,482	918,610	99,318	73,488
19	オペレーショナル・リスク	3,202,710	3,201,774	256,216	256,141
20	うち、基礎的手法適用分	647,827	647,827	51,826	51,826
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	2,554,883	2,553,946	204,390	204,315
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	1,278,905	1,239,667	105,507	102,287
	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)	63,219,955	60,599,128	5,057,596	4,847,930

みずほフィナンシャルグループ【連結】
2019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	386,946	
2	当四半期中の要因別の変動額	資産の規模	7,854
3		ポートフォリオの質	△ 309
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	2,905
8		その他	661
9	当四半期末時点における信用リスク・アセットの額	398,058	

- 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12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	9,547	
2	当四半期中の要因別の変動額	資産の規模	△ 438
3		取引相手方の信用力	63
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	157
8		その他	10
9	当四半期末時点における信用リスク・アセットの額	9,341	

みずほフィナンシャルグループ【連結】
2019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	2,329	6,856	-	-		9,186	
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	2.26	2.72	-	-		2.59	
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	1,027	2,519	-	-		3,546	
2	当四半期中の 要因別の変動額	リスク量の変動	78	527	-	-		605
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	148	239	-	-		387
7		その他	△ 85	△ 173	-	-		△ 258
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	1,168	3,112	-	-		4,281	
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	2.90	2.89	-	-		2.89	
8c	当四半期末におけるリスク・アセット	3,393	9,021	-	-		12,414	