

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】
2020年3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	
		2020年3月末	2019年12月末	2020年3月末	2019年12月末
1	信用リスク	38,378,848	38,630,551	3,237,808	3,259,411
2	うち、標準的手法適用分	1,943,907	1,919,904	155,512	153,592
3	うち、内部格付手法適用分	34,895,880	35,201,439	2,959,170	2,985,082
	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	1,539,061	1,509,207	123,124	120,736
4	カウンターパーティ信用リスク	4,515,574	4,274,504	367,950	347,576
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	165,699	201,219	13,700	16,684
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	1,216,072	934,123	102,437	78,672
	うち、CVAリスク	2,137,870	2,076,626	171,029	166,130
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	163,062	178,262	13,044	14,261
	その他	832,869	884,272	67,737	71,827
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	2,327,117	2,424,641	197,339	205,609
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）	5,104,213	6,035,392	431,577	510,403
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%）	588,916	697,769	49,940	59,170
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%）	93,039	108,461	7,443	8,676
11	未決済取引	17,380	11,632	1,462	986
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	1,050,808	1,120,667	84,064	89,653
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	799,189	816,737	63,935	65,339
14	うち、外部格付準拠方式適用分	242,645	295,079	19,411	23,606
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	8,973	8,850	717	708
16	マーケット・リスク	2,476,959	2,679,806	198,156	214,384
17	うち、標準的方式適用分	1,063,932	1,438,324	85,114	115,065
18	うち、内部モデル方式適用分	1,413,026	1,241,482	113,042	99,318
19	オペレーショナル・リスク	3,355,977	3,202,710	268,478	256,216
20	うち、基礎的手法適用分	664,565	647,827	53,165	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	2,691,412	2,554,883	215,312	204,390
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	1,548,246	1,278,905	127,076	105,507
	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)	62,141,217	63,219,955	4,971,297	5,057,596

みずほフィナンシャルグループ【連結】
2020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	398,058	
2	当四半期中の要因別の変動額	資産の規模	397
3		ポートフォリオの質	962
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	△ 2,622
8		その他	△ 687
9		当四半期末時点における信用リスク・アセットの額	396,109

- 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】
2020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	9,341	
2	当四半期中の要因別の変動額	資産の規模	3,111
3		取引相手方の信用力	△ 95
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	△ 182
8		その他	△ 13
9		当四半期末時点における信用リスク・アセットの額	12,160

みずほフィナンシャルグループ【連結】
2020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								
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	3,393	9,021	-	-		12,414	
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	2.90	2.89	-	-		2.89	
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	1,168	3,112	-	-		4,281	
2	当四半期中の 要因別の変動額	リスク量の変動	△ 313	12	-	-		△ 301
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	△ 218	△ 592	-	-		△ 810
7		その他	1,265	269	-	-		1,535
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	1,902	2,801	-	-		4,704	
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	2.11	3.60	-	-		3.00	
8c	当四半期末におけるリスク・アセット	4,023	10,106	-	-		14,130	