

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6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	
		2020年6月末	2020年3月末	2020年6月末	2020年3月末
1	信用リスク	40,524,558	38,378,848	3,419,874	3,237,808
2	うち、標準的手法適用分	1,971,620	1,943,907	157,729	155,512
3	うち、内部格付手法適用分	37,064,627	34,895,880	3,143,080	2,959,170
	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	1,488,309	1,539,061	119,064	123,124
4	カウンターパーティ信用リスク	4,290,680	4,515,574	349,364	367,950
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	185,564	165,699	15,258	13,700
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	1,175,773	1,216,072	98,987	102,437
	うち、CVAリスク	2,008,347	2,137,870	160,667	171,029
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	181,889	163,062	14,551	13,044
	その他	739,105	832,869	59,899	67,737
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	2,363,509	2,327,117	200,425	197,339
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）	5,729,537	5,104,213	484,657	431,577
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%）	757,951	588,916	64,274	49,940
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%）	94,762	93,039	7,581	7,443
11	未決済取引	19,469	17,380	1,650	1,462
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	1,053,239	1,050,808	84,259	84,064
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	813,354	799,189	65,068	63,935
14	うち、外部格付準拠方式適用分	239,412	242,645	19,152	19,411
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	472	8,973	37	717
16	マーケット・リスク	2,690,391	2,476,959	215,231	198,156
17	うち、標準的方式適用分	1,161,648	1,063,932	92,931	85,114
18	うち、内部モデル方式適用分	1,528,743	1,413,026	122,299	113,042
19	オペレーショナル・リスク	3,358,635	3,355,977	268,690	268,478
20	うち、基礎的手法適用分	664,565	664,565	53,165	53,165
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	2,694,070	2,691,412	215,525	215,312
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	1,440,156	1,548,246	118,420	127,076
	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)	65,180,377	62,141,217	5,214,430	4,971,297

みずほフィナンシャルグループ【連結】
2020年6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	396,109	
2	当四半期中の要因別の変動額	資産の規模	13,463
3		ポートフォリオの質	7,791
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	△ 153
8		その他	177
9		当四半期末時点における信用リスク・アセットの額	417,388

- 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6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	12,160	
2	当四半期中の要因別の変動額	資産の規模	△ 475
3		取引相手方の信用力	102
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	△ 34
8		その他	4
9		当四半期末時点における信用リスク・アセットの額	11,757

みずほフィナンシャルグループ【連結】
2020年6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	4,023	10,106	-	-		14,130	
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	2.11	3.60	-	-		3.00	
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	1,902	2,801	-	-		4,704	
2	当四半期中の 要因別の変動額	リスク量の変動	△ 520	△ 454	-	-		△ 975
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	236	124	-	-		361
7		その他	174	304	-	-		479
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	1,793	2,776	-	-		4,569	
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	3.49	3.24	-	-		3.34	
8c	当四半期末におけるリスク・アセット	6,273	9,014	-	-		15,287	