

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	
		2020年9月末	2020年6月末	2020年9月末	2020年6月末
1	信用リスク	40,583,267	40,524,558	3,424,325	3,419,874
2	うち、標準的手法適用分	2,072,056	1,971,620	165,764	157,729
3	うち、内部格付手法適用分	37,013,372	37,064,627	3,138,734	3,143,080
	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	1,497,838	1,488,309	119,827	119,064
4	カウンターパーティ信用リスク	4,255,024	4,290,680	346,544	349,364
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	213,471	185,564	17,681	15,258
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	1,165,775	1,175,773	98,110	98,987
	うち、CVAリスク	1,996,899	2,008,347	159,751	160,667
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	177,078	181,889	14,166	14,551
	その他	701,799	739,105	56,834	59,899
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	2,000,261	2,363,509	169,622	200,425
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）	5,948,455	5,729,537	503,088	484,657
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%）	583,791	757,951	49,505	64,274
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%）	135,417	94,762	10,833	7,581
11	未決済取引	2,728	19,469	230	1,650
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	1,035,139	1,053,239	82,811	84,259
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	794,217	813,354	63,537	65,068
14	うち、外部格付準拠方式適用分	240,453	239,412	19,236	19,152
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	467	472	37	37
16	マーケット・リスク	2,373,910	2,690,391	189,912	215,231
17	うち、標準的方式適用分	1,127,173	1,161,648	90,173	92,931
18	うち、内部モデル方式適用分	1,246,737	1,528,743	99,738	122,299
19	オペレーショナル・リスク	3,268,390	3,358,635	261,471	268,690
20	うち、基礎的手法適用分	695,179	664,565	55,614	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	2,573,211	2,694,070	205,856	215,525
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	1,384,607	1,440,156	114,053	118,420
	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）	64,404,983	65,180,377	5,152,398	5,214,430

みずほフィナンシャルグループ【連結】
2020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	417,388	
2	当四半期中の要因別の変動額	資産の規模	△ 9,620
3		ポートフォリオの質	5,993
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	△ 1,054
8		その他	23
9	当四半期末時点における信用リスク・アセットの額	412,729	

- 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	11,757	
2	当四半期中の要因別の変動額	資産の規模	△ 94
3		取引相手方の信用力	65
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	△ 75
8		その他	5
9	当四半期末時点における信用リスク・アセットの額	11,657	

みずほフィナンシャルグループ【連結】
2020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	6,273	9,014	-	-		15,287	
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	3.49	3.24	-	-		3.34	
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	1,793	2,776	-	-		4,569	
2	当四半期中の 要因別の変動額	リスク量の変動	△ 658	△ 194	-	-		△ 852
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	△ 67	△ 154	-	-		△ 221
7		その他	52	△ 8	-	-		43
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	1,119	2,419	-	-		3,538	
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	4.12	3.24	-	-		3.52	
8c	当四半期末におけるリスク・アセット	4,614	7,853	-	-		12,467	