

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	
		2020年12月末	2020年9月末	2020年12月末	2020年9月末
1	信用リスク	40,604,389	40,583,267	3,425,814	3,424,325
2	うち、標準的手法適用分	2,080,955	2,072,056	166,476	165,764
3	うち、内部格付手法適用分	36,971,500	37,013,372	3,135,183	3,138,734
	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	1,551,933	1,497,838	124,154	119,827
4	カウンターパーティ信用リスク	4,124,635	4,255,024	336,143	346,544
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	242,993	213,471	19,952	17,681
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	1,131,183	1,165,775	95,241	98,110
	うち、CVAリスク	1,785,558	1,996,899	142,844	159,751
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	181,283	177,078	14,502	14,166
	その他	783,616	701,799	63,602	56,834
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	3,026,949	2,000,261	256,685	169,622
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）	6,482,290	5,948,455	548,497	503,088
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%）	598,402	583,791	50,744	49,505
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%）	205,216	135,417	16,417	10,833
11	未決済取引	2,522	2,728	213	230
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	1,076,504	1,035,139	86,120	82,811
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	835,367	794,217	66,829	63,537
14	うち、外部格付準拠方式適用分	240,565	240,453	19,245	19,236
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	232	-	18	-
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	338	467	27	37
16	マーケット・リスク	2,459,919	2,373,910	196,793	189,912
17	うち、標準的方式適用分	1,212,688	1,127,173	97,015	90,173
18	うち、内部モデル方式適用分	1,247,231	1,246,737	99,778	99,738
19	オペレーショナル・リスク	3,270,154	3,268,390	261,612	261,471
20	うち、基礎的手法適用分	695,179	695,179	55,614	55,614
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	2,574,975	2,573,211	205,998	205,856
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	1,344,075	1,384,607	110,933	114,053
	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）	66,124,705	64,404,983	5,289,976	5,152,398

みずほフィナンシャルグループ【連結】
2020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	412,729	
2	当四半期中の要因別の変動額	資産の規模	8,065
3		ポートフォリオの質	2,292
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	△ 971
8		その他	144
9		当四半期末時点における信用リスク・アセットの額	422,261

- 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12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	11,657	
2	当四半期中の要因別の変動額	資産の規模	△ 367
3		取引相手方の信用力	93
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	△ 79
8		その他	8
9		当四半期末時点における信用リスク・アセットの額	11,311

みずほフィナンシャルグループ【連結】
2020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	4,614	7,853	-	-		12,467	
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	4.12	3.24	-	-		3.52	
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	1,119	2,419	-	-		3,538	
2	当四半期中の 要因別の変動額	リスク量の変動	△ 90	△ 31	-	-		△ 121
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	60	△ 135	-	-		△ 75
7		その他	△ 181	135	-	-		△ 46
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	907	2,387	-	-		3,295	
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	4.21	3.62	-	-		3.78	
8c	当四半期末におけるリスク・アセット	3,825	8,647	-	-		12,472	