

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】
2021年3月末

(単位：百万円)

OV1: 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	
		2021年3月末	2020年12月末	2021年3月末	2020年12月末
1	信用リスク	41,573,999	40,604,389	3,508,692	3,425,814
2	うち、標準的手法適用分	1,871,761	2,080,955	149,740	166,476
3	うち、内部格付手法適用分	38,077,677	36,971,500	3,228,987	3,135,183
	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	1,624,560	1,551,933	129,964	124,154
4	カウンターパーティ信用リスク	4,459,369	4,124,635	363,487	336,143
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	448,051	242,993	37,510	19,952
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	1,078,444	1,131,183	90,701	95,241
	うち、CVAリスク	1,982,240	1,785,558	158,579	142,844
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	166,104	181,283	13,288	14,502
	その他	784,529	783,616	63,407	63,602
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	3,427,692	3,026,949	290,668	256,685
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）	6,166,277	6,482,290	521,846	548,497
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%）	609,005	598,402	51,643	50,744
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%）	156,266	205,216	12,519	16,417
11	未決済取引	2,730	2,522	230	213
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	1,150,473	1,076,504	92,037	86,120
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	921,663	835,367	73,733	66,829
14	うち、外部格付準拠方式適用分	228,207	240,565	18,256	19,245
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	249	232	19	18
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	353	338	28	27
16	マーケット・リスク	2,328,664	2,459,919	186,293	196,793
17	うち、標準的方式適用分	1,160,121	1,212,688	92,809	97,015
18	うち、内部モデル方式適用分	1,168,542	1,247,231	93,483	99,778
19	オペレーショナル・リスク	3,192,568	3,270,154	255,405	261,612
20	うち、基礎的手法適用分	701,380	695,179	56,110	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	2,491,188	2,574,975	199,295	205,998
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	1,402,410	1,344,075	115,734	110,933
	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）	67,481,983	66,124,705	5,398,558	5,289,976

みずほフィナンシャルグループ【連結】
2021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	422,261	
2	当四半期中の要因別の変動額	資産の規模	2,233
3		ポートフォリオの質	4,479
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	7,973
8		その他	678
9		当四半期末時点における信用リスク・アセットの額	437,625

- 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】
2021年3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	11,311	
2	当四半期中の要因別の 変動額	資産の規模	△ 1,075
3		取引相手方の信用力	84
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	453
8		その他	9
9		当四半期末時点における信用リスク・アセットの額	10,784

みずほフィナンシャルグループ【連結】
2021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	3,825	8,647	-	-		12,472	
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	4.21	3.62	-	-		3.78	
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	907	2,387	-	-		3,295	
2	当四半期中の 要因別の変動額	リスク量の変動	△ 80	△ 429	-	-		△ 511
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	△ 322	△ 80	-	-		△ 403
7		その他	438	1,028	-	-		1,466
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	942	2,905	-	-		3,848	
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	3.05	3.02	-	-		3.03	
8c	当四半期末におけるリスク・アセット	2,880	8,804	-	-		11,685	