

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6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	
		2021年6月末	2021年3月末	2021年6月末	2021年3月末
1	信用リスク	41,054,322	41,573,999	3,464,435	3,508,692
2	うち、標準的手法適用分	1,887,519	1,871,761	151,001	149,740
3	うち、内部格付手法適用分	37,518,758	38,077,677	3,181,590	3,228,987
	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	1,648,044	1,624,560	131,843	129,964
4	カウンターパーティ信用リスク	4,040,340	4,459,369	329,214	363,487
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	190,819	448,051	15,785	37,510
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	1,141,055	1,078,444	96,041	90,701
	うち、CVAリスク	1,850,757	1,982,240	148,060	158,579
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	174,085	166,104	13,926	13,288
	その他	683,620	784,529	55,400	63,407
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	4,239,524	3,427,692	359,511	290,668
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）	6,209,174	6,166,277	525,482	521,846
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%）	562,696	609,005	47,716	51,643
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%）	230,035	156,266	18,403	12,519
11	未決済取引	2,980	2,730	251	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	1,095,908	1,150,473	87,672	92,037
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	876,904	921,663	70,152	73,733
14	うち、外部格付準拠方式適用分	218,416	228,207	17,473	18,256
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	233	249	18	19
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	353	353	28	28
16	マーケット・リスク	2,357,820	2,328,664	188,625	186,293
17	うち、標準的方式適用分	1,391,310	1,160,121	111,304	92,809
18	うち、内部モデル方式適用分	966,509	1,168,542	77,320	93,483
19	オペレーショナル・リスク	3,198,579	3,192,568	255,886	255,405
20	うち、基礎的手法適用分	798,501	701,380	63,880	56,110
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	2,400,078	2,491,188	192,006	199,295
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	1,355,543	1,402,410	112,183	115,734
	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(スケールリング・ファクター勘案後)	67,367,304	67,481,983	5,389,384	5,398,558

みずほフィナンシャルグループ【連結】  
2021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	437,625	
2	当四半期中の要因別の変動額	資産の規模	969
3		ポートフォリオの質	1,163
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	173
8		その他	80
9	当四半期末時点における信用リスク・アセットの額	440,011	

- 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	10,784	
2	当四半期中の要因別の変動額	資産の規模	652
3		取引相手方の信用力	△ 30
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	3
8		その他	-
9		当四半期末時点における信用リスク・アセットの額	11,410

みずほフィナンシャルグループ【連結】  
2021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	2,880	8,804	-	-		11,685	
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	3.05	3.02	-	-		3.03	
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	942	2,905	-	-		3,848	
2	当四半期中の 要因別の変動額	リスク量の変動	△ 398	△ 202	-	-		△ 602
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	△ 19	△ 8	-	-		△ 28
7		その他	789	△ 140	-	-		649
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	1,313	2,554	-	-		3,867	
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	2.56	2.46	-	-		2.49	
8c	当四半期末におけるリスク・アセット	3,373	6,291	-	-		9,665	