

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	
		2021年9月末	2021年6月末	2021年9月末	2021年6月末
1	信用リスク	41,275,421	41,054,322	3,483,531	3,464,435
2	うち、標準的手法適用分	1,892,684	1,887,519	151,414	151,001
3	うち、内部格付手法適用分	37,812,051	37,518,758	3,206,461	3,181,590
	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	1,570,685	1,648,044	125,654	131,843
4	カウンターパーティ信用リスク	4,219,942	4,040,340	343,434	329,214
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	206,570	190,819	17,086	15,785
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	1,199,922	1,141,055	100,653	96,041
	うち、CVAリスク	1,823,733	1,850,757	145,898	148,060
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	175,461	174,085	14,036	13,926
	その他	814,254	683,620	65,758	55,400
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	4,119,148	4,239,524	349,303	359,511
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）	5,764,047	6,209,174	487,760	525,482
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%）	491,934	562,696	41,716	47,716
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%）	269,934	230,035	21,604	18,403
11	未決済取引	19,765	2,980	1,675	251
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	1,060,025	1,095,908	84,802	87,672
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	863,250	876,904	69,060	70,152
14	うち、外部格付準拠方式適用分	196,167	218,416	15,693	17,473
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	251	233	20	18
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	356	353	28	28
16	マーケット・リスク	2,375,853	2,357,820	190,068	188,625
17	うち、標準的方式適用分	1,284,799	1,391,310	102,783	111,304
18	うち、内部モデル方式適用分	1,091,053	966,509	87,284	77,320
19	オペレーショナル・リスク	3,220,395	3,198,579	257,631	255,886
20	うち、基礎的手法適用分	820,929	798,501	65,674	63,880
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	2,399,465	2,400,078	191,957	192,006
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	1,331,126	1,355,543	110,289	112,183
	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）	67,147,718	67,367,304	5,371,817	5,389,384

みずほフィナンシャルグループ【連結】
2021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	440,011	
2	当四半期中の要因別の変動額	資産の規模	1,627
3		ポートフォリオの質	△ 1,023
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	691
8		その他	△ 166
9		当四半期末時点における信用リスク・アセットの額	441,139

- 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9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	11,410	
2	当四半期中の要因別の変動額	資産の規模	593
3		取引相手方の信用力	△ 44
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	39
8		その他	0
9		当四半期末時点における信用リスク・アセットの額	11,999

みずほフィナンシャルグループ【連結】
2021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	3,373	6,291	-	-		9,665	
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	2.56	2.46	-	-		2.49	
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	1,313	2,554	-	-		3,867	
2	当四半期中の 要因別の変動額	リスク量の変動	291	290	-	-		583
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	△ 39	△ 108	-	-		△ 148
7		その他	△ 284	67	-	-		△ 216
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	1,281	2,803	-	-		4,084	
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	2.97	2.53	-	-		2.67	
8c	当四半期末におけるリスク・アセット	3,809	7,101	-	-		10,910	