

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	
		2021年12月末	2021年9月末	2021年12月末	2021年9月末
1	信用リスク	41,321,753	41,275,421	3,487,480	3,483,531
2	うち、標準的手法適用分	1,852,809	1,892,684	148,224	151,414
3	うち、内部格付手法適用分	37,862,654	37,812,051	3,210,753	3,206,461
	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	1,606,289	1,570,685	128,503	125,654
4	カウンターパーティ信用リスク	4,136,735	4,219,942	336,500	343,434
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	172,090	206,570	14,226	17,086
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	1,052,344	1,199,922	88,511	100,653
	うち、CVAリスク	1,978,576	1,823,733	158,286	145,898
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	143,915	175,461	11,513	14,036
	その他	789,809	814,254	63,963	65,758
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	3,533,617	4,119,148	299,650	349,303
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）	5,348,121	5,764,047	452,502	487,760
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%）	700,972	491,934	59,442	41,716
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%）	211,945	269,934	16,958	21,604
11	未決済取引	1,837	19,765	154	1,675
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	1,004,028	1,060,025	80,322	84,802
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	838,231	863,250	67,058	69,060
14	うち、外部格付準拠方式適用分	165,183	196,167	13,214	15,693
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	251	251	20	20
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	363	356	29	28
16	マーケット・リスク	2,236,429	2,375,853	178,914	190,068
17	うち、標準的方式適用分	1,013,448	1,284,799	81,075	102,783
18	うち、内部モデル方式適用分	1,222,980	1,091,053	97,838	87,284
19	オペレーショナル・リスク	3,218,603	3,220,395	257,488	257,631
20	うち、基礎的手法適用分	820,929	820,929	65,674	65,674
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	2,397,673	2,399,465	191,813	191,957
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	1,698,278	1,331,126	139,732	110,289
	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)	66,364,348	67,147,718	5,309,147	5,371,817

みずほフィナンシャルグループ【連結】
2021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	441,139	
2	当四半期中の要因別の変動額	資産の規模	△ 2,550
3		ポートフォリオの質	△ 3,277
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	3,862
8		その他	207
9		当四半期末時点における信用リスク・アセットの額	439,381

- 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	11,999	
2	当四半期中の要因別の変動額	資産の規模	△ 1,706
3		取引相手方の信用力	38
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	186
8		その他	6
9		当四半期末時点における信用リスク・アセットの額	10,523

みずほフィナンシャルグループ【連結】
2021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	3,809	7,101	-	-		10,910	
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	2.97	2.53	-	-		2.67	
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	1,281	2,803	-	-		4,084	
2	当四半期中の 要因別の変動額	リスク量の変動	6	△ 657	-	-		△ 652
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	△ 199	△ 275	-	-		△ 475
7		その他	92	439	-	-		531
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	1,180	2,309	-	-		3,489	
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	3.53	3.48	-	-		3.50	
8c	当四半期末におけるリスク・アセット	4,172	8,057	-	-		12,229	