

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】
2022年3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	
		2022年3月末	2021年12月末	2022年3月末	2021年12月末
1	信用リスク	40,885,256	41,321,753	3,449,683	3,487,480
2	うち、標準的手法適用分	1,937,947	1,852,809	155,035	148,224
3	うち、内部格付手法適用分	37,263,038	37,862,654	3,159,905	3,210,753
	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	1,684,270	1,606,289	134,741	128,503
4	カウンターパーティ信用リスク	4,606,704	4,136,735	374,631	336,500
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	243,346	172,090	20,169	14,226
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	1,008,311	1,052,344	84,793	88,511
	うち、CVAリスク	2,108,205	1,978,576	168,656	158,286
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	183,747	143,915	14,699	11,513
	その他	1,063,093	789,809	86,311	63,963
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	2,613,592	3,533,617	221,632	299,650
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）	4,090,892	5,348,121	345,975	452,502
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%）	811,245	700,972	68,793	59,442
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%）	227,679	211,945	18,854	16,958
11	未決済取引	3,179	1,837	263	154
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	972,440	1,004,028	77,795	80,322
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	823,411	838,231	65,872	67,058
14	うち、外部格付準拠方式適用分	148,600	165,183	11,888	13,214
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	255	251	20	20
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	173	363	13	29
16	マーケット・リスク	2,357,907	2,236,429	188,632	178,914
17	うち、標準的方式適用分	977,368	1,013,448	78,189	81,075
18	うち、内部モデル方式適用分	1,380,539	1,222,980	110,443	97,838
19	オペレーショナル・リスク	3,244,374	3,218,603	259,549	257,488
20	うち、基礎的手法適用分	848,593	820,929	67,887	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	2,395,780	2,397,673	191,662	191,813
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	2,109,475	1,698,278	172,623	139,732
	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）	64,730,439	66,364,348	5,178,435	5,309,147

みずほフィナンシャルグループ【連結】
2022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	439,381	
2	当四半期中の要因別の変動額	資産の規模	△ 10,702
3		ポートフォリオの質	△ 10,681
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	9,447
8		その他	337
9		当四半期末時点における信用リスク・アセットの額	427,782

- 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】
2022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	10,523	
2	当四半期中の要因別の変動額	資産の規模	△ 715
3		取引相手方の信用力	△ 151
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	412
8		その他	14
9		当四半期末時点における信用リスク・アセットの額	10,083

みずほフィナンシャルグループ【連結】
2022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	へ
		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	4,172	8,057	-	-		12,229
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	3.53	3.48	-	-		3.50
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	1,180	2,309	-	-		3,489
2	当四半期中の 要因別の変動額	リスク量の変動	△ 440	△ 276	-	-	△ 715
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	△ 401	85	-	-	△ 315
7		その他	1,484	1,448	-	-	2,933
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	1,823	3,567	-	-		5,390
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	2.55	-	-		2.56
8c	当四半期末におけるリスク・アセット	4,675	9,129	-	-		13,805