

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	
		2022年9月末	2022年6月末	2022年9月末	2022年6月末
1	信用リスク	44,145,834	42,934,645	3,724,335	3,622,581
2	うち、標準的手法適用分	2,359,110	2,097,812	188,728	167,824
3	うち、内部格付手法適用分	40,139,326	39,127,113	3,403,814	3,317,979
	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	1,647,397	1,709,719	131,791	136,777
4	カウンターパーティ信用リスク	5,051,051	4,468,107	411,149	363,938
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	379,034	290,899	31,457	24,197
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	1,118,290	1,046,438	93,990	87,957
	うち、CVAリスク	2,057,540	1,925,085	164,603	154,006
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	313,362	283,465	25,069	22,677
	その他	1,182,824	922,217	96,029	75,098
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	3,840,876	3,530,662	325,706	299,400
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）	4,282,522	4,336,932	362,216	366,795
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%）	836,976	790,359	70,975	67,022
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%）	132,244	115,039	10,688	9,249
11	未決済取引	9,948	21,685	827	1,833
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	1,302,509	1,082,620	104,200	86,609
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	1,134,880	922,740	90,790	73,819
14	うち、外部格付準拠方式適用分	166,774	159,270	13,341	12,741
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	263	267	21	21
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	591	342	47	27
16	マーケット・リスク	2,581,676	2,563,415	206,534	205,073
17	うち、標準的方式適用分	1,026,871	1,117,036	82,149	89,362
18	うち、内部モデル方式適用分	1,554,805	1,446,379	124,384	115,710
19	オペレーショナル・リスク	3,289,168	3,243,689	263,133	259,495
20	うち、基礎的手法適用分	886,917	848,593	70,953	67,887
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	2,402,251	2,395,095	192,180	191,607
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	2,785,282	2,588,462	227,179	211,167
	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）	71,336,840	68,664,591	5,706,947	5,493,167

みずほフィナンシャルグループ【連結】
2022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	460,489	
2	当四半期中の要因別の変動額	資産の規模	9,323
3		ポートフォリオの質	△ 1,170
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	7,543
8		その他	△ 479
9		当四半期末時点における信用リスク・アセットの額	475,706

- 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	10,464	
2	当四半期中の要因別の変動額	資産の規模	336
3		取引相手方の信用力	62
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	320
8		その他	△ 1
9		当四半期末時点における信用リスク・アセットの額	11,182

みずほフィナンシャルグループ【連結】
2022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 バリュー・ アット・ リスク	ロ ストレス・ バリュー・ アット・ リスク	ハ 追加的 リスク	ニ 包括的 リスク	ホ その他	ヘ 合計
1a	前四半期末におけるリスク・アセット	5,429	9,034	-	-		14,463
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	2.78	2.78	-	-		2.78
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	1,948	3,244	-	-		5,192
2	当四半期中の 要因別の変動額	リスク量の変動	△ 782	△ 619	-	-	△ 1,403
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	△ 956	△ 870	-	-	△ 1,827
7		その他	1,887	1,299	-	-	3,186
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	2,095	3,054	-	-		5,149
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	3.15	2.92	-	-		3.01
8c	当四半期末におけるリスク・アセット	6,604	8,943	-	-		15,548