

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	
		2022年12月末	2022年9月末	2022年12月末	2022年9月末
1	信用リスク	43,905,864	44,145,834	3,703,501	3,724,335
2	うち、標準的手法適用分	2,352,837	2,359,110	188,227	188,728
3	うち、内部格付手法適用分	39,798,348	40,139,326	3,374,899	3,403,814
	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	1,754,678	1,647,397	140,374	131,791
4	カウンターパーティ信用リスク	4,454,160	5,051,051	363,235	411,149
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	322,464	379,034	26,831	31,457
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	1,003,933	1,118,290	84,253	93,990
	うち、CVAリスク	1,663,363	2,057,540	133,069	164,603
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	300,891	313,362	24,071	25,069
	その他	1,163,508	1,182,824	95,010	96,029
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	3,932,758	3,840,876	333,497	325,706
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）	4,375,270	4,282,522	370,078	362,216
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%）	872,548	836,976	73,992	70,975
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%）	94,719	132,244	7,695	10,688
11	未決済取引	4,894	9,948	397	827
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	1,305,921	1,302,509	104,473	104,200
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	1,145,274	1,134,880	91,621	90,790
14	うち、外部格付準拠方式適用分	159,603	166,774	12,768	13,341
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	218	263	17	21
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	824	591	65	47
16	マーケット・リスク	2,676,754	2,581,676	214,140	206,534
17	うち、標準的方式適用分	981,643	1,026,871	78,531	82,149
18	うち、内部モデル方式適用分	1,695,111	1,554,805	135,608	124,384
19	オペレーショナル・リスク	3,285,203	3,289,168	262,816	263,133
20	うち、基礎的手法適用分	886,917	886,917	70,953	70,953
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	2,398,286	2,402,251	191,862	192,180
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	2,905,618	2,785,282	237,563	227,179
	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）	70,892,406	71,336,840	5,671,392	5,706,947

みずほフィナンシャルグループ【連結】  
2022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	475,706	
2	当四半期中の要因別の変動額	資産の規模	7,036
3		ポートフォリオの質	2,748
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	△ 13,686
8		その他	695
9		当四半期末時点における信用リスク・アセットの額	472,500

- 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	11,182	
2	当四半期中の要因別の変動額	資産の規模	△ 612
3		取引相手方の信用力	5
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	△ 536
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	10,039

みずほフィナンシャルグループ【連結】  
2022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	6,604	8,943	-	-		15,548	
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	3.15	2.92	-	-		3.01	
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	2,095	3,054	-	-		5,149	
2	当四半期中の 要因別の変動額	リスク量の変動	△ 3,214	△ 1,850	-	-		△ 5,065
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	△ 1,982	△ 1,962	-	-		△ 3,944
7		その他	5,141	3,559	-	-		8,700
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	2,040	2,800	-	-		4,840	
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	3.40	3.57	-	-		3.50	
8c	当四半期末におけるリスク・アセット	6,953	9,997	-	-		16,951	