

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】
2023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	
		2023年3月末	2022年12月末	2023年3月末	2022年12月末
1	信用リスク	42,805,132	43,905,864	3,610,442	3,703,501
2	うち、標準的手法適用分	2,312,405	2,352,837	184,992	188,227
3	うち、内部格付手法適用分	38,756,705	39,798,348	3,286,568	3,374,899
	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	1,736,021	1,754,678	138,881	140,374
4	カウンターパーティ信用リスク	4,779,126	4,454,160	388,728	363,235
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	335,109	322,464	27,684	26,831
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	935,129	1,003,933	78,542	84,253
	うち、CVAリスク	1,820,083	1,663,363	145,606	133,069
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	276,222	300,891	22,097	24,071
	その他	1,412,582	1,163,508	114,796	95,010
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	3,954,016	3,932,758	335,300	333,497
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）	4,913,343	4,375,270	415,679	370,078
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%）	832,944	872,548	70,633	73,992
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%）	79,740	94,719	6,490	7,695
11	未決済取引	4,785	4,894	396	397
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	1,421,908	1,305,921	113,752	104,473
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	1,266,925	1,145,274	101,354	91,621
14	うち、外部格付準拠方式適用分	153,953	159,603	12,316	12,768
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	204	218	16	17
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	824	824	65	65
16	マーケット・リスク	2,664,443	2,676,754	213,155	214,140
17	うち、標準的方式適用分	1,028,809	981,643	82,304	78,531
18	うち、内部モデル方式適用分	1,635,634	1,695,111	130,850	135,608
19	オペレーショナル・リスク	3,274,392	3,285,203	261,951	262,816
20	うち、基礎的手法適用分	939,980	886,917	75,198	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	2,334,411	2,398,286	186,752	191,862
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	2,666,857	2,905,618	218,201	237,563
	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）	70,434,154	70,892,406	5,634,732	5,671,392

みずほフィナンシャルグループ【連結】
2023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	472,500	
2	当四半期中の要因別の変動額	資産の規模	△ 7,976
3		ポートフォリオの質	△ 4,872
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	1,884
8		その他	53
9	当四半期末時点における信用リスク・アセットの額	461,590	

- 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】
2023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	10,039	
2	当四半期中の要因別の変動額	資産の規模	△ 487
3		取引相手方の信用力	△ 264
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	65
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	9,351

みずほフィナンシャルグループ【連結】
2023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	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	6,953	9,997	-	-		16,951	
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	3.40	3.57	-	-		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	2,040	2,800	-	-		4,840	
2	当四半期中の 要因別の変動額	リスク量の変動	846	551	-	-		1,398
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	13	△ 32	-	-		△ 18
7		その他	△ 187	112	-	-		△ 75
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	2,713	3,431	-	-		6,144	
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	2.49	2.79	-	-		2.66	
8c	当四半期末におけるリスク・アセット	6,766	9,590	-	-		16,356	