

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6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6月末	2023年3月末	2023年6月末	2023年3月末
1	信用リスク	44,051,613	42,805,132	3,715,429	3,610,442
2	うち、標準的手法適用分	2,391,202	2,312,405	191,296	184,992
3	うち、内部格付手法適用分	39,854,228	38,756,705	3,379,638	3,286,568
	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	1,806,181	1,736,021	144,494	138,881
4	カウンターパーティ信用リスク	5,131,006	4,779,126	417,570	388,728
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	376,468	335,109	31,076	27,684
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	1,067,731	935,129	89,570	78,542
	うち、CVAリスク	1,926,152	1,820,083	154,092	145,606
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	319,571	276,222	25,565	22,097
	その他	1,441,083	1,412,582	117,264	114,796
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	4,822,510	3,954,016	408,948	335,300
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）	5,061,366	4,913,343	428,272	415,679
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%）	822,405	832,944	69,739	70,633
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%）	92,316	79,740	7,535	6,490
11	未決済取引	1,819	4,785	152	396
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	1,615,362	1,421,908	129,228	113,752
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	1,457,174	1,266,925	116,573	101,354
14	うち、外部格付準拠方式適用分	157,112	153,953	12,568	12,316
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	182	204	14	16
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	892	824	71	65
16	マーケット・リスク	3,208,180	2,664,443	256,654	213,155
17	うち、標準的方式適用分	1,472,072	1,028,809	117,765	82,304
18	うち、内部モデル方式適用分	1,736,108	1,635,634	138,888	130,850
19	オペレーショナル・リスク	3,268,073	3,274,392	261,445	261,951
20	うち、基礎的手法適用分	939,980	939,980	75,198	75,198
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	2,328,092	2,334,411	186,247	186,752
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	2,609,643	2,666,857	213,754	218,201
	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(スケールリング・ファクター勘案後)	73,859,172	70,434,154	5,908,733	5,634,732

みずほフィナンシャルグループ【連結】
2023年6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	461,590	
2	当四半期中の要因別の変動額	資産の規模	5,690
3		ポートフォリオの質	△ 485
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	14,148
8		その他	△ 229
9		当四半期末時点における信用リスク・アセットの額	480,714

- 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6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	9,351	
2	当四半期中の要因別の変動額	資産の規模	766
3		取引相手方の信用力	△ 29
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	583
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	10,677

みずほフィナンシャルグループ【連結】
2023年6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	6,766	9,590	-	-		16,356	
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	2.49	2.79	-	-		2.66	
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	2,713	3,431	-	-		6,144	
2	当四半期中の 要因別の変動額	リスク量の変動	△ 1,261	△ 407	-	-		△ 1,670
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	△ 1,678	△ 1,318	-	-		△ 2,996
7		その他	2,442	1,646	-	-		4,089
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	2,215	3,352	-	-		5,568	
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	3.01	3.18	-	-		3.11	
8c	当四半期末におけるリスク・アセット	6,691	10,669	-	-		17,361	