

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	
		2023年9月末	2023年6月末	2023年9月末	2023年6月末
1	信用リスク	44,812,508	44,051,613	3,779,971	3,715,429
2	うち、標準的手法適用分	2,511,109	2,391,202	200,888	191,296
3	うち、内部格付手法適用分	40,618,817	39,854,228	3,444,475	3,379,638
	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	1,682,582	1,806,181	134,606	144,494
4	カウンターパーティ信用リスク	5,546,137	5,131,006	451,755	417,570
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	498,549	376,468	41,082	31,076
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	902,611	1,067,731	75,930	89,570
	うち、CVAリスク	1,741,189	1,926,152	139,295	154,092
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	452,980	319,571	36,238	25,565
	その他	1,950,806	1,441,083	159,208	117,264
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	5,457,389	4,822,510	462,786	408,948
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）	5,650,888	5,061,366	478,203	428,272
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%）	856,785	822,405	72,655	69,739
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%）	132,923	92,316	10,770	7,535
11	未決済取引	2,560	1,819	213	152
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	1,738,708	1,615,362	139,096	129,228
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	1,584,645	1,457,174	126,771	116,573
14	うち、外部格付準拠方式適用分	152,931	157,112	12,234	12,568
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	187	182	14	14
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	944	892	75	71
16	マーケット・リスク	3,456,279	3,208,180	276,502	256,654
17	うち、標準的方式適用分	1,506,745	1,472,072	120,539	117,765
18	うち、内部モデル方式適用分	1,949,533	1,736,108	155,962	138,888
19	オペレーショナル・リスク	3,352,203	3,268,073	268,176	261,445
20	うち、基礎的手法適用分	1,032,748	939,980	82,619	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	2,319,455	2,328,092	185,556	186,247
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	2,744,825	2,609,643	224,949	213,754
	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)	77,063,504	73,859,172	6,165,080	5,908,733

みずほフィナンシャルグループ【連結】
2023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	480,714	
2	当四半期中の要因別の変動額	資産の規模	10,023
3		ポートフォリオの質	1,113
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	4,225
8		その他	△ 55
9		当四半期末時点における信用リスク・アセットの額	496,021

- 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	10,677	
2	当四半期中の要因別の変動額	資産の規模	△ 1,941
3		取引相手方の信用力	122
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	171
8		その他	△ 3
9		当四半期末時点における信用リスク・アセットの額	9,026

みずほフィナンシャルグループ【連結】
2023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	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	6,691	10,669	-	-		17,361	
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	3.01	3.18	-	-		3.11	
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	2,215	3,352	-	-		5,568	
2	当四半期中の 要因別の変動額	リスク量の変動	408	3,623	-	-		4,031
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	△ 124	△ 155	-	-		△ 279
7		その他	75	112	-	-		188
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	2,576	6,933	-	-		9,510	
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	2.61	1.84	-	-		2.04	
8c	当四半期末におけるリスク・アセット	6,728	12,766	-	-		19,495	