

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	
		2023年12月末	2023年9月末	2023年12月末	2023年9月末
1	信用リスク	43,978,638	44,812,508	3,708,556	3,779,971
2	うち、標準的手法適用分	2,635,535	2,511,109	210,842	200,888
3	うち、内部格付手法適用分	39,638,730	40,618,817	3,361,364	3,444,475
	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	1,704,371	1,682,582	136,349	134,606
4	カウンターパーティ信用リスク	5,501,521	5,546,137	447,841	451,755
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	453,663	498,549	37,527	41,082
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	920,225	902,611	77,562	75,930
	うち、CVAリスク	2,019,808	1,741,189	161,584	139,295
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	422,730	452,980	33,818	36,238
	その他	1,685,093	1,950,806	137,348	159,208
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	5,105,503	5,457,389	432,946	462,786
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）	5,502,656	5,650,888	465,630	478,203
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%）	807,890	856,785	68,509	72,655
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%）	111,058	132,923	8,973	10,770
11	未決済取引	42,427	2,560	3,592	213
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	1,721,639	1,738,708	137,731	139,096
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	1,575,960	1,584,645	126,076	126,771
14	うち、外部格付準拠方式適用分	144,536	152,931	11,562	12,234
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	140	187	11	14
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	1,002	944	80	75
16	マーケット・リスク	4,123,905	3,456,279	329,912	276,502
17	うち、標準的方式適用分	1,830,073	1,506,745	146,405	120,539
18	うち、内部モデル方式適用分	2,293,832	1,949,533	183,506	155,962
19	オペレーショナル・リスク	3,352,510	3,352,203	268,200	268,176
20	うち、基礎的手法適用分	1,032,748	1,032,748	82,619	82,619
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	2,319,762	2,319,455	185,580	185,556
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	2,566,776	2,744,825	211,257	224,949
	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)	76,039,413	77,063,504	6,083,153	6,165,080

みずほフィナンシャルグループ【連結】
2023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	496,021	
2	当四半期中の要因別の変動額	資産の規模	△ 12,606
3		ポートフォリオの質	3,774
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	△ 7,084
8		その他	427
9		当四半期末時点における信用リスク・アセットの額	480,532

- 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	9,026	
2	当四半期中の要因別の変動額	資産の規模	607
3		取引相手方の信用力	△ 118
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	△ 317
8		その他	4
9		当四半期末時点における信用リスク・アセットの額	9,202

みずほフィナンシャルグループ【連結】
2023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 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	6,728	12,766	-	-		19,495
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	2.61	1.84	-	-		2.04
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	2,576	6,933	-	-		9,510
2	当四半期中の 要因別の変動額	リスク量の変動	△ 1,057	△ 2,915	-	-	△ 3,973
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	170	△ 191	-	-	△ 21
7		その他	143	185	-	-	329
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	1,832	4,012	-	-		5,844
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	3.66	4.04	-	-		3.92
8c	当四半期末におけるリスク・アセット	6,715	16,222	-	-		22,938