

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】

2024年3月末

(単位：百万円)

0V1: リスク・アセットの概要				
国際様式の 該当番号		イ	ロ	ハ
		リスク・アセット		所要自己資本
		2024年3月末	2023年12月末	2024年3月末
				2023年12月末
1	信用リスク	45,655,567	43,978,638	3,652,445
2	うち、標準的手法適用分	5,451,469	2,635,535	436,117
	うち、内部格付手法適用分		39,638,730	3,361,364
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	23,648,632		1,891,890
4	うち、スロットティング・クライテリア適用分	643,779		51,502
5	うち、先進的内部格付手法適用分	13,941,090		1,115,287
	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	1,970,594	1,704,371	157,647
6	カウンターパーティ信用リスク	3,391,832	5,501,521	271,346
7	うち、SA-CCR適用分	667,412	-	53,393
	うち、カレント・エクスポージャー方式適用分		453,663	37,527
8	うち、期待エクスポージャー方式適用分	676,498	920,225	54,119
	うち、CVAリスク		2,019,808	161,584
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	283,152	422,730	22,651
9	その他	1,764,768	1,685,093	141,181
10	CVAリスク	1,913,735		153,098
	うち、SA-CVA適用分	504,875		40,390
	うち、完全なBA-CVA適用分	823,945		65,915
	うち、限定的なBA-CVA適用分	584,914		46,793
	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	432,946
11	経過措置により適用されるマーケット・ベース方式に基づく株式等エクスポージャー	4,506,494		360,519
12	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）	3,957,323	5,502,656	316,585
13	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%）	365,350	-	29,228
	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%）	123,723	807,890	9,897
14	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%）	67,030	111,058	5,362
15	未決済取引	18,497	42,427	1,479
16	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	2,465,934	1,721,639	197,274
	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	126,076
17	うち、内部格付手法準拠方式適用分	1,895,710		151,656
	うち、外部格付準拠方式適用分		144,536	11,562
18	うち、外部格付準拠方式又は内部評価方式適用分	131,628		10,530
19	うち、標準的手法準拠方式適用分	437,682	140	35,014
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	913	1,002	73
20	マーケット・リスク	3,573,200	4,123,905	285,856
21	うち、標準的方式適用分	3,554,448	1,830,073	284,355
22	うち、内部モデル方式適用分	-	2,293,832	-
	うち、簡易的方式適用分	18,751		1,500
23	勘定間の振替分	-	-	-
24	オペレーショナル・リスク	4,075,171	3,352,510	326,013
	うち、基礎的手法適用分		1,032,748	82,619
	うち、粗利益配分手法適用分		-	-
	うち、先進的計測手法適用分		2,319,762	185,580
25	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	2,606,384	2,566,776	208,510
	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		-	-
26	フロア調整	-	-	-
27	合計	72,720,245	76,039,413	5,817,619
				6,083,153

注） 2023年12月末のリスク・アセットの合計は、スケーリング・ファクター勘案後の数値です。

みずほフィナンシャルグループ【連結】

2024年3月末

(単位：百万円)

CVA4：CVAリスク・エクスポージャーのCVAリスク相当額の変動表		
項番		CVAリスク相当額
1	前四半期末	
2	当四半期末	153,098
	変動事由の説明	

みずほフィナンシャルグループ【連結】

2024年3月末

(単位：百万円)

CMS1：内部モデルを用いた手法と標準的手法のリスク・アセットの比較					
項番		イ	ロ	ハ	ニ
		リスク・アセットの額			
		内部モデルを用いて算出したリスク・アセットの額	標準的な手法適用分のリスク・アセットの額	リスク・アセットの額	資本フロア計算に用いられる、標準的な手法により算出したリスク・アセットの額（フロア掛目前）
1	信用リスク	38,233,502	5,451,469	43,684,972	86,781,412
2	カウンターパーティ信用リスク	1,597,044	1,794,788	3,391,832	6,693,371
3	CVAリスク		1,913,735	1,913,735	1,913,735
4	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	1,895,710	570,224	2,465,934	2,511,083
5	マーケット・リスク	-	3,573,200	3,573,200	3,573,200
6	オペレーショナル・リスク		4,075,171	4,075,171	4,075,171
7	その他リスク・アセット		13,615,398	13,615,398	8,864,722
8	合計	41,726,257	30,993,988	72,720,245	114,412,697

(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		480,532
2	当四半期中の要因別 の変動額	資産の規模	15,802
3		ポートフォリオの質	△ 5,451
4		モデルの更新	-
5		手法及び方針	△ 39,588
6		買収又は売却	-
7		為替の変動	9,719
8		その他	△ 179
9	当四半期末時点における信用リスク・アセットの額		460,835

注) 1. 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起因するリスク・アセットの変動額です。

2. 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起因するリスク・アセットの変動額です。

3. 手法及び方針は、当局による規制の変更による計算法の変更起因するリスク・アセットの変動額です。

4. 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】
2024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		9,202
2	当四半期中の要因別 の変動額	資産の規模	△ 1,113
3		取引相手方の信用力	△ 177
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）	△ 1,509
6		買収又は売却	-
7		為替の変動	363
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		6,764