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

みずほ銀行【連結】
2025年3月末

（単位：百万円）

OV1:リスク・アセットの概要

国際様式の該当番号		イ	ロ	ハ	ニ
		リスク・アセット		所要自己資本	
		2025年3月末	2024年12月末	2025年3月末	2024年12月末
1	信用リスク	44,227,124	46,081,431	3,538,169	3,686,514
2	うち、標準的手法適用分	5,519,971	4,730,684	441,597	378,454
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	23,411,205	25,196,529	1,872,896	2,015,722
4	うち、スロッティング・クライテリア適用分	529,629	561,929	42,370	44,954
5	うち、先進的内部格付手法適用分	13,238,978	14,020,641	1,059,118	1,121,651
	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	1,527,339	1,571,647	122,187	125,731
6	カウンターパーティ信用リスク	2,193,816	2,605,088	175,505	208,407
7	うち、SA－CCR適用分	426,726	477,686	34,138	38,214
8	うち、期待エクスポージャー方式適用分	684,162	739,106	54,733	59,128
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	214,510	230,873	17,160	18,469
9	その他	868,417	1,157,422	69,473	92,593
10	CVAリスク	1,727,527	1,528,539	138,202	122,283
	うち、SA－CVA適用分	502,855	521,169	40,228	41,693
	うち、完全なBA－CVA適用分	1,101,592	885,229	88,127	70,818
	うち、限定的なBA－CVA適用分	123,079	122,140	9,846	9,771
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	1,881,452	1,830,283	150,516	146,422
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）	3,584,174	3,852,769	286,733	308,222
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（マンデート方式）	－	－	－	－
	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%）	126,853	131,739	10,148	10,539
	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%）	－	－	－	－
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%）	265,476	203,163	21,238	16,253
15	未決済取引	6,535	70,172	522	5,613
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	3,241,149	3,192,608	259,291	255,408
17	うち、内部格付手法準拠方式適用分	2,635,435	2,582,741	210,834	206,619
18	うち、外部格付準拠方式又は内部評価方式適用分	52,931	74,068	4,234	5,925
19	うち、標準的手法準拠方式適用分	551,635	534,771	44,130	42,781
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	1,147	1,027	91	82
20	マーケット･リスク	2,352,815	2,076,698	188,225	166,135
21	うち、標準的方式適用分	2,350,635	2,073,131	188,050	165,850
22	うち、内部モデル方式適用分	－	－	－	－
	うち、簡易的方式適用分	2,180	3,567	174	285
23	勘定間の振替分	－	－	－	－
24	オペレーショナル・リスク	3,658,025	3,533,118	292,642	282,649
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	2,614,495	2,051,009	209,159	164,080
26	フロア調整	－	－	－	－
27	合計	65,879,448	67,156,622	5,270,355	5,372,531

みずほ銀行【連結】
2025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	122,283
2	当四半期末	138,202
	変動事由の説明	EAD増加によるBA-CVAのCVAリスク相当額の増加に伴い、全体のCVAリスク相当額は増加しております。

みずほ銀行【連結】

2025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	37,179,813	5,519,971	42,699,784	83,667,895
2	カウンターパーティ信用リスク	1,470,120	723,695	2,193,816	5,352,877
3	CVAリスク		1,727,527	1,727,527	1,727,527
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	2,635,435	605,714	3,241,149	2,901,311
5	マーケット・リスク	－	2,352,815	2,352,815	2,352,815
6	オペレーショナル・リスク		3,658,025	3,658,025	3,658,025
7	その他リスク・アセット		10,006,328	10,006,328	7,452,540
8	合計	41,285,369	24,594,079	65,879,448	107,112,994