

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6月末

(単位：百万円)

OV1: 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					
		2024年6月末	2024年3月末	2024年6月末	2024年3月末				
1	信用リスク	47,200,721	45,655,567	3,776,057	3,652,445				
2	うち、標準的手法適用分	5,488,026	5,451,469	439,042	436,117				
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	25,152,764	23,648,632	2,012,221	1,891,890				
4	うち、スロットティング・クライテリア適用分	616,145	643,779	49,291	51,502				
5	うち、先進的内部格付手法適用分	13,940,161	13,941,090	1,115,212	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	2,003,622	1,970,594	160,289	157,647				
6	カウンターパーティ信用リスク	3,449,302	3,391,832	275,944	271,346				
7	うち、SA-CCR適用分	702,659	667,412	56,212	53,393				
8	うち、期待エクスポージャー方式適用分	752,004	676,498	60,160	54,119				
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	279,341	283,152	22,347	22,651				
9	その他	1,715,296	1,764,768	137,223	141,181				
10	CVAリスク	1,976,221	1,913,735	158,097	153,098				
	うち、SA-CVA適用分	551,429	504,875	44,114	40,390				
	うち、完全なBA-CVA適用分	781,146	823,945	62,491	65,915				
	うち、限定的なBA-CVA適用分	643,645	584,914	51,491	46,793				
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	2,353,925	4,506,494	188,314	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）	3,776,112	3,957,323	302,088	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（マンドレート方式）	-	-	-	-				
	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%）	327,854	365,350	26,228	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%）	122,761	123,723	9,820	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%）	175,312	67,030	14,025	5,362				
15	未決済取引	9,309	18,497	744	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	2,716,985	2,465,934	217,358	197,274				
17	うち、内部格付手法準拠方式適用分	2,045,959	1,895,710	163,676	151,656				
18	うち、外部格付準拠方式又は内部評価方式適用分	72,581	131,628	5,806	10,530				
19	うち、標準的手法準拠方式適用分	597,516	437,682	47,801	35,014				
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	927	913	74	73				
20	マーケット・リスク	3,188,630	3,573,200	255,090	285,856				
21	うち、標準的方式適用分	3,171,614	3,554,448	253,729	284,355				
22	うち、内部モデル方式適用分	-	-	-	-				
	うち、簡易的方式適用分	17,016	18,751	1,361	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	4,075,171	326,013	326,013				
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	2,952,553	2,606,384	236,204	208,510				
26	フロア調整	-	-	-	-				
27	合計	72,324,861	72,720,245	5,785,988	5,817,619				

みずほフィナンシャルグループ【連結】

2024年6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	153,098
2	当四半期末	158,097
	変動事由の説明	取引相手方のクレジット・スプレッド・リスクによる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。

みずほフィナンシャルグループ【連結】

2024年6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	39,709,071	5,488,026	45,197,098	88,986,085
2	カウンターパーティ信用リスク	1,684,526	1,764,776	3,449,302	6,922,588
3	CVAリスク		1,976,221	1,976,221	1,976,221
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	2,045,959	671,025	2,716,985	2,648,191
5	マーケット・リスク	-	3,188,630	3,188,630	3,188,630
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		11,721,451	11,721,451	8,638,474
8	合計	43,439,558	28,885,303	72,324,861	116,435,362

みずほフィナンシャルグループ【連結】
2024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	460,835	
2	当四半期中の要因別の変動額	資産の規模	△ 16,384
3		ポートフォリオの質	1,696
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	11,521
8		その他	-
9		当四半期末時点における信用リスク・アセットの額	457,668

- 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に起因するリスク・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に起因するリスク・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手法の変更に起因するリスク・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	6,764	
2	当四半期中の要因別の変動額	資産の規模	418
3		取引相手方の信用力	17
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	318
8		その他	-
9		当四半期末時点における信用リスク・アセットの額	7,520