

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9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9月末	2024年6月末	2024年9月末	2024年6月末
1	信用リスク	44,861,027	47,200,721	3,588,882	3,776,057
2	うち、標準的手法適用分	5,271,579	5,488,026	421,726	439,042
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	23,773,645	25,152,764	1,901,891	2,012,221
4	うち、スロットティング・クライテリア適用分	558,623	616,145	44,689	49,291
5	うち、先進的内部格付手法適用分	13,572,597	13,940,161	1,085,807	1,115,212
	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	1,684,580	2,003,622	134,766	160,289
6	カウンターパーティ信用リスク	3,233,888	3,449,302	258,711	275,944
7	うち、SA-CCR適用分	598,328	702,659	47,866	56,212
8	うち、期待エクスポージャー方式適用分	836,834	752,004	66,946	60,160
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	222,485	279,341	17,798	22,347
9	その他	1,576,239	1,715,296	126,099	137,223
10	CVAリスク	1,902,121	1,976,221	152,169	158,097
	うち、SA-CVA適用分	504,490	551,429	40,359	44,114
	うち、完全なBA-CVA適用分	722,138	781,146	57,771	62,491
	うち、限定的なBA-CVA適用分	675,492	643,645	54,039	51,491
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	1,967,793	2,353,925	157,423	188,314
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）	3,693,829	3,776,112	295,506	302,088
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%）	278,527	327,854	22,282	26,228
	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%）	138,107	122,761	11,048	9,820
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%）	258,472	175,312	20,677	14,025
15	未決済取引	2,690	9,309	215	744
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	2,790,832	2,716,985	223,266	217,358
17	うち、内部格付手法準拠方式適用分	2,146,587	2,045,959	171,726	163,676
18	うち、外部格付準拠方式又は内部評価方式適用分	76,084	72,581	6,086	5,806
19	うち、標準的手法準拠方式適用分	567,159	597,516	45,372	47,801
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	1,000	927	80	74
20	マーケット・リスク	3,449,441	3,188,630	275,955	255,090
21	うち、標準的方式適用分	3,435,329	3,171,614	274,826	253,729
22	うち、内部モデル方式適用分	-	-	-	-
	うち、簡易的方式適用分	14,112	17,016	1,128	1,361
23	勘定間の振替分	-	-	-	-
24	オペレーショナル・リスク	4,531,543	4,075,171	362,523	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	2,651,943	2,952,553	212,155	236,204
26	フロア調整	-	-	-	-
27	合計	69,760,218	72,324,861	5,580,817	5,785,988

みずほフィナンシャルグループ【連結】

2024年9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	158,097
2	当四半期末	152,169
	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リスク相当額の減少に伴い、全体のCVAリスク相当額は減少しております。

みずほフィナンシャルグループ【連結】

2024年9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	37,904,867	5,271,579	43,176,446	85,003,280
2	カウンターパーティ信用リスク	1,604,356	1,629,531	3,233,888	6,475,716
3	CVAリスク		1,902,121	1,902,121	1,902,121
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	2,146,587	644,244	2,790,832	2,566,336
5	マーケット・リスク	-	3,449,441	3,449,441	3,449,441
6	オペレーショナル・リスク		4,531,543	4,531,543	4,531,543
7	その他リスク・アセット		10,675,944	10,675,944	7,791,678
8	合計	41,655,811	28,104,407	69,760,218	111,720,117

みずほフィナンシャルグループ【連結】
2024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	457,668	
2	当四半期中の要因別の変動額	資産の規模	△ 9,657
3		ポートフォリオの質	5,207
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	△ 20,078
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	433,139

- 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法の変更等に起因するリスク・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	7,520	
2	当四半期中の要因別の変動額	資産の規模	1,524
3		取引相手方の信用力	△ 59
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	△ 616
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	8,368