

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%） | 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 |