

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12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	
		2024年12月末	2024年9月末	2024年12月末	2024年9月末
1	信用リスク	47,065,153	44,861,027	3,765,212	3,588,882
2	うち、標準的手法適用分	5,093,343	5,271,579	407,467	421,726
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	25,310,165	23,773,645	2,024,813	1,901,891
4	うち、スロットティング・クライテリア適用分	561,929	558,623	44,954	44,689
5	うち、先進的内部格付手法適用分	14,317,066	13,572,597	1,145,365	1,085,807
	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	1,782,649	1,684,580	142,611	134,766
6	カウンターパーティ信用リスク	3,448,065	3,233,888	275,845	258,711
7	うち、SA-CCR適用分	673,259	598,328	53,860	47,866
8	うち、期待エクスポージャー方式適用分	805,699	836,834	64,455	66,946
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	254,621	222,485	20,369	17,798
9	その他	1,714,485	1,576,239	137,158	126,099
10	CVAリスク	1,984,751	1,902,121	158,780	152,169
	うち、SA-CVA適用分	516,078	504,490	41,286	40,359
	うち、完全なBA-CVA適用分	793,621	722,138	63,489	57,771
	うち、限定的なBA-CVA適用分	675,051	675,492	54,004	54,039
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	2,178,713	1,967,793	174,297	157,423
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）	4,196,724	3,693,829	335,738	295,506
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%）	291,007	278,527	23,280	22,282
	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%）	64,862	138,107	5,188	11,048
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%）	238,225	258,472	19,058	20,677
15	未決済取引	71,100	2,690	5,688	215
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	3,195,804	2,790,832	255,664	223,266
17	うち、内部格付手法準拠方式適用分	2,585,937	2,146,587	206,875	171,726
18	うち、外部格付準拠方式又は内部評価方式適用分	74,068	76,084	5,925	6,086
19	うち、標準的手法準拠方式適用分	534,771	567,159	42,781	45,372
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	1,027	1,000	82	80
20	マーケット・リスク	3,027,764	3,449,441	242,221	275,955
21	うち、標準的方式適用分	3,011,695	3,435,329	240,935	274,826
22	うち、内部モデル方式適用分	-	-	-	-
	うち、簡易的方式適用分	16,069	14,112	1,285	1,128
23	勘定間の振替分	-	-	-	-
24	オペレーショナル・リスク	4,531,543	4,531,543	362,523	362,523
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	3,391,390	2,651,943	271,311	212,155
26	フロア調整	-	-	-	-
27	合計	73,685,106	69,760,218	5,894,808	5,580,817

みずほフィナンシャルグループ【連結】

2024年12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	152,169
2	当四半期末	158,780
	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。

みずほフィナンシャルグループ【連結】

2024年12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	40,189,160	5,093,343	45,282,504	88,225,648
2	カウンターパーティ信用リスク	1,743,066	1,704,998	3,448,065	6,598,463
3	CVAリスク		1,984,751	1,984,751	1,984,751
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	2,585,937	609,866	3,195,804	2,969,402
5	マーケット・リスク	-	3,027,764	3,027,764	3,027,764
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		12,214,673	12,214,673	8,980,851
8	合計	44,518,165	29,166,941	73,685,106	116,318,425

(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		433,139
2	当四半期中の要因別 の変動額	資産の規模	13,764
3		ポートフォリオの質	2,049
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	15,463
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		464,416

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12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		8,368
2	当四半期中の要因別 の変動額	資産の規模	△ 859
3		取引相手方の信用力	91
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	456
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		8,056