

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】
2025年3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					
		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	45,288,850	47,065,153	3,623,108	3,765,212				
2	うち、標準的手法適用分	5,972,759	5,093,343	477,820	407,467				
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	23,550,825	25,310,165	1,884,066	2,024,813				
4	うち、スロットティング・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	13,500,709	14,317,066	1,080,056	1,145,365				
	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	1,734,926	1,782,649	138,794	142,611				
6	カウンターパーティ信用リスク	3,353,480	3,448,065	268,278	275,845				
7	うち、SA-CCR適用分	629,916	673,259	50,393	53,860				
8	うち、期待エクスポージャー方式適用分	739,953	805,699	59,196	64,455				
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	238,772	254,621	19,101	20,369				
9	その他	1,744,837	1,714,485	139,587	137,158				
10	CVAリスク	2,016,628	1,984,751	161,330	158,780				
	うち、SA-CVA適用分	498,482	516,078	39,878	41,286				
	うち、完全なBA-CVA適用分	872,162	793,621	69,772	63,489				
	うち、限定的なBA-CVA適用分	645,983	675,051	51,678	54,004				
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	2,215,575	2,178,713	177,246	174,297				
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）	3,916,569	4,196,724	313,325	335,738				
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%）	280,147	291,007	22,411	23,280				
	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%）	50,715	64,862	4,057	5,188				
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%）	304,307	238,225	24,344	19,058				
15	未決済取引	6,635	71,100	530	5,688				
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	3,244,244	3,195,804	259,539	255,664				
17	うち、内部格付手法準拠方式適用分	2,638,530	2,585,937	211,082	206,875				
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	2,998,842	3,027,764	239,907	242,221				
21	うち、標準的方式適用分	2,982,400	3,011,695	238,592	240,935				
22	うち、内部モデル方式適用分	-	-	-	-				
	うち、簡易的方式適用分	16,442	16,069	1,315	1,285				
23	勘定間の振替分	-	-	-	-				
24	オペレーショナル・リスク	4,664,488	4,531,543	373,159	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	3,503,914	3,391,390	280,313	271,311				
26	フロア調整	-	-	-	-				
27	合計	71,844,402	73,685,106	5,747,552	5,894,808				

みずほフィナンシャルグループ【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	158,780
2	当四半期末	161,330
	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】

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	37,581,165	5,972,759	43,553,924	85,183,362
2	カウンターパーティ信用リスク	1,520,643	1,832,837	3,353,480	6,479,506
3	CVAリスク		2,016,628	2,016,628	2,016,628
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	2,638,530	605,714	3,244,244	2,902,544
5	マーケット・リスク	-	2,998,842	2,998,842	2,998,842
6	オペレーショナル・リスク		4,664,488	4,664,488	4,664,488
7	その他リスク・アセット		12,012,792	12,012,792	9,138,371
8	合計	41,740,338	30,104,064	71,844,402	113,383,745

みずほフィナンシャルグループ【連結】
2025年3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	464,416	
2	当四半期中の要因別の変動額	資産の規模	△ 12,313
3		ポートフォリオの質	△ 977
4		モデルの更新	-
5		手法及び方針	△ 553
6		買収又は売却	-
7		為替の変動	△ 9,111
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	441,461

- 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等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】
2025年3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	8,056	
2	当四半期中の要因別の 変動額	資産の規模	△ 331
3		取引相手方の信用力	△ 53
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	△ 272
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	7,399