

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

みずほ銀行【連結】
2025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					
		2025年6月末	2025年3月末	2025年6月末	2025年3月末	2025年6月末	2025年3月末	2025年6月末	2025年3月末
1	信用リスク	44,155,031	44,227,124	3,532,402	3,538,169				
2	うち、標準的手法適用分	5,701,897	5,519,971	456,151	441,597				
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	23,328,206	23,411,205	1,866,256	1,872,896				
4	うち、スロッシング・クライテリア適用分	464,882	529,629	37,190	42,370				
5	うち、先進的内部格付手法適用分	13,078,724	13,238,978	1,046,297	1,059,118				
	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	1,581,320	1,527,339	126,505	122,187				
6	カウンターパーティ信用リスク	2,179,931	2,193,816	174,394	175,505				
7	うち、SA-CCR適用分	407,806	426,726	32,624	34,138				
8	うち、期待エクスポージャー方式適用分	707,788	684,162	56,623	54,733				
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	208,555	214,510	16,684	17,160				
9	その他	855,780	868,417	68,462	69,473				
10	CVAリスク	1,647,806	1,727,527	131,824	138,202				
	うち、SA-CVA適用分	527,374	502,855	42,189	40,228				
	うち、完全なBA-CVA適用分	984,238	1,101,592	78,739	88,127				
	うち、限定的なBA-CVA適用分	136,193	123,079	10,895	9,846				
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	2,703,964	1,881,452	216,317	150,516				
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）	3,875,382	3,584,174	310,030	286,733				
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（マંデート方式）	7,529	-	602	-				
	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%）	130,660	126,853	10,452	10,148				
	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%）	-	-	-	-				
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%）	196,124	265,476	15,689	21,238				
15	未決済取引	4,407	6,535	352	522				
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	3,302,807	3,241,149	264,224	259,291				
17	うち、内部格付手法準拠方式適用分	2,646,269	2,635,435	211,701	210,834				
18	うち、外部格付準拠方式又は内部評価方式適用分	53,049	52,931	4,243	4,234				
19	うち、標準的手法準拠方式適用分	602,266	551,635	48,181	44,130				
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	1,223	1,147	97	91				
20	マーケット・リスク	2,611,299	2,352,815	208,903	188,225				
21	うち、標準的方式適用分	2,608,800	2,350,635	208,704	188,050				
22	うち、内部モデル方式適用分	-	-	-	-				
	うち、簡易的方式適用分	2,499	2,180	199	174				
23	勘定間の振替分	-	-	-	-				
24	オペレーショナル・リスク	3,658,025	3,658,025	292,642	292,642				
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	2,526,068	2,614,495	202,085	209,159				
26	フロア調整	-	-	-	-				
27	合計	66,999,039	65,879,448	5,359,923	5,270,355				

みずほ銀行【連結】

2025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	138,202
2	当四半期末	131,824
	変動事由の説明	EAD減少によるBA-CVAの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。

みずほ銀行【連結】

2025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	36,871,812	5,701,897	42,573,710	84,665,276
2	カウンターパーティ信用リスク	1,427,553	752,377	2,179,931	5,293,980
3	CVAリスク		1,647,806	1,647,806	1,647,806
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	2,646,269	656,538	3,302,807	2,807,850
5	マーケット・リスク	-	2,611,299	2,611,299	2,611,299
6	オペレーショナル・リスク		3,658,025	3,658,025	3,658,025
7	その他リスク・アセット		11,025,458	11,025,458	8,010,202
8	合計	40,945,636	26,053,403	66,999,039	108,694,442

(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	425,476	
2	当四半期中の要因別の変動額	資産の規模	5,052
3		ポートフォリオの質	2,940
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	△ 2,761
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	430,707	

- 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。

みずほ銀行【連結】
2025年6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	6,841	
2	当四半期中の要因別の変動額	資産の規模	351
3		取引相手方の信用力	△ 45
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	△ 69
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	7,077	