

## 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					
		2025年9月末	2025年6月末	2025年9月末	2025年6月末				
1	信用リスク	44,840,475	44,155,031	3,587,238	3,532,402				
2	うち、標準的手法適用分	6,087,681	5,701,897	487,014	456,151				
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	23,617,007	23,328,206	1,889,360	1,866,256				
4	うち、スロットティング・クライテリア適用分	349,047	464,882	27,923	37,190				
5	うち、先進的内部格付手法適用分	13,285,166	13,078,724	1,062,813	1,046,297				
	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	1,501,570	1,581,320	120,125	126,505				
6	カウンターパーティ信用リスク	2,356,670	2,179,931	188,533	174,394				
7	うち、SA-CCR適用分	423,431	407,806	33,874	32,624				
8	うち、期待エクスポージャー方式適用分	759,224	707,788	60,737	56,623				
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	239,902	208,555	19,192	16,684				
9	その他	934,110	855,780	74,728	68,462				
10	CVAリスク	1,811,832	1,647,806	144,946	131,824				
	うち、SA-CVA適用分	522,905	527,374	41,832	42,189				
	うち、完全なBA-CVA適用分	1,137,857	984,238	91,028	78,739				
	うち、限定的なBA-CVA適用分	151,069	136,193	12,085	10,895				
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	1,973,667	2,703,964	157,893	216,317				
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）	3,914,265	3,875,382	313,141	310,030				
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）	-	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%）	146,287	130,660	11,702	10,452				
	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%）	157,544	196,124	12,603	15,689				
15	未決済取引	17,985	4,407	1,438	352				
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	3,288,364	3,302,807	263,069	264,224				
17	うち、内部格付手法準拠方式適用分	2,589,623	2,646,269	207,169	211,701				
18	うち、外部格付準拠方式又は内部評価方式適用分	47,329	53,049	3,786	4,243				
19	うち、標準的手法準拠方式適用分	650,091	602,266	52,007	48,181				
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	1,319	1,223	105	97				
20	マーケット・リスク	2,858,467	2,611,299	228,677	208,903				
21	うち、標準的方式適用分	2,856,302	2,608,800	228,504	208,704				
22	うち、内部モデル方式適用分	-	-	-	-				
	うち、簡易的方式適用分	2,164	2,499	173	199				
23	勘定間の振替分	-	-	-	-				
24	オペレーショナル・リスク	3,922,559	3,658,025	313,804	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	2,344,558	2,526,068	187,564	202,085				
26	フロア調整	-	-	-	-				
27	合計	67,632,678	66,999,039	5,410,614	5,359,923				

みずほ銀行【連結】

2025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	131,824
2	当四半期末	144,947
	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。

みずほ銀行【連結】

2025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	37,251,222	6,087,681	43,338,904	86,603,560
2	カウンターパーティ信用リスク	1,564,082	792,587	2,356,670	5,347,981
3	CVAリスク		1,811,832	1,811,832	1,811,832
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	2,589,623	698,741	3,288,364	2,764,050
5	マーケット・リスク	-	2,858,467	2,858,467	2,858,467
6	オペレーショナル・リスク		3,922,559	3,922,559	3,922,559
7	その他リスク・アセット		10,055,880	10,055,880	7,479,484
8	合計	41,404,928	26,227,750	67,632,678	110,787,936

(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	430,707	
2	当四半期中の要因別の変動額	資産の規模	△ 8,491
3		ポートフォリオの質	△ 1,856
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	4,309
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	424,668

- 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9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	7,077	
2	当四半期中の要因別の変動額	資産の規模	349
3		取引相手方の信用力	△ 7
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	171
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	7,592	