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	45,199,330	45,288,850	3,615,946	3,623,108				
2	うち、標準的手法適用分	6,136,764	5,972,759	490,941	477,820				
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	23,492,211	23,550,825	1,879,376	1,884,066				
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	13,329,822	13,500,709	1,066,385	1,080,056				
	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	1,775,649	1,734,926	142,051	138,794				
6	カウンターパーティ信用リスク	3,104,669	3,353,480	248,373	268,278				
7	うち、SA-CCR適用分	643,358	629,916	51,468	50,393				
8	うち、期待エクスポージャー方式適用分	745,474	739,953	59,637	59,196				
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	225,008	238,772	18,000	19,101				
9	その他	1,490,828	1,744,837	119,266	139,587				
10	CVAリスク	2,088,073	2,016,628	167,045	161,330				
	うち、SA-CVA適用分	523,208	498,482	41,856	39,878				
	うち、完全なBA-CVA適用分	901,704	872,162	72,136	69,772				
	うち、限定的なBA-CVA適用分	663,160	645,983	53,052	51,678				
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	3,050,058	2,215,575	244,004	177,246				
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）	4,184,476	3,916,569	334,758	313,325				
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%）	283,375	280,147	22,670	22,411				
	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%）	45,166	50,715	3,613	4,057				
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%）	229,905	304,307	18,392	24,344				
15	未決済取引	3,063	6,635	245	530				
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	3,306,060	3,244,244	264,484	259,539				
17	うち、内部格付手法準拠方式適用分	2,649,521	2,638,530	211,961	211,082				
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	3,327,531	2,998,842	266,202	239,907				
21	うち、標準的方式適用分	3,312,804	2,982,400	265,024	238,592				
22	うち、内部モデル方式適用分	-	-	-	-				
	うち、簡易的方式適用分	14,727	16,442	1,178	1,315				
23	勘定間の振替分	-	-	-	-				
24	オペレーショナル・リスク	4,664,488	4,664,488	373,159	373,159				
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	3,417,809	3,503,914	273,424	280,313				
26	フロア調整	-	-	-	-				
27	合計	72,911,538	71,844,402	5,832,923	5,747,552				

みずほフィナンシャルグループ【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	161,330
2	当四半期末	167,045
	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	37,286,915	6,136,764	43,423,680	86,182,194
2	カウンターパーティ信用リスク	1,459,818	1,644,851	3,104,669	6,259,025
3	CVAリスク		2,088,073	2,088,073	2,088,073
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	2,649,521	656,538	3,306,060	2,809,128
5	マーケット・リスク	-	3,327,531	3,327,531	3,327,531
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		12,997,034	12,997,034	9,669,069
8	合計	41,396,256	31,515,282	72,911,538	114,999,512