

みずほ信託銀行連結の主要な指標

バーゼル銀行監督委員会の合意に基づく自己資本比率規制では、自己資本比率等の最低水準を充足することが求められています。

当行は、「銀行法第14条の2の規定に基づき、銀行がその保有する資産等に照らし自己資本の充実の状況が適当であるかどうかを判断するための基準」（平成18年金融庁告示第19号）に基づき、連結自己資本比率を算出しています。

また、当行は、「銀行法第14条の2の規定に基づき、銀行がその保有する資産等に照らし自己資本の充実の状況が適当であるかどうかを判断するための基準の補完的指標として定めるレバレッジに係る健全性を判断するための基準」（平成31年金融庁告示第11号）に基づき、連結レバレッジ比率を算出しています。

バーゼル銀行監督委員会の合意に基づく流動性比率規制では、流動性カバレッジ比率及び安定調達比率の最低水準を充足することが求められています。当行は、「銀行法第14条の2の規定に基づき、銀行がその経営の健全性を判断するための基準として定める流動性に係る健全性を判断するための基準」（平成26年金融庁告示第60号、以下「告示第60号」）に基づき、連結流動性カバレッジ比率（以下「連結LCR」）及び連結安定調達比率（以下「連結NSFR」）を算出しています。

■主要な指標

KM1：主要な指標

(単位：百万円、%)

国際様式の 該当番号		イ	ロ	ハ	ニ	ホ
		2023年度 第2四半期末	2023年度 第1四半期末	2022年度 第4四半期末	2022年度 第3四半期末	2022年度 第2四半期末
資本						
1	普通株式等Tier 1 資本の額	471,507	460,215	444,732	464,879	453,330
2	Tier 1 資本の額	471,524	460,230	444,748	464,893	453,345
3	総自己資本の額	471,676	460,373	444,929	464,953	453,401
リスク・アセット						
4	リスク・アセットの額	1,659,176	1,662,894	1,714,312	1,656,826	1,702,856
自己資本比率						
5	連結普通株式等Tier 1 比率	28.41%	27.67%	25.94%	28.05%	26.62%
6	連結Tier 1 比率	28.41%	27.67%	25.94%	28.05%	26.62%
7	連結総自己資本比率	28.42%	27.68%	25.95%	28.06%	26.62%
連結レバレッジ比率						
13	総エクスポージャーの額	4,070,999	4,432,823	4,191,401	4,326,112	4,290,626
14	連結レバレッジ比率	11.58%	10.38%	10.61%	10.74%	10.56%
連結流動性カバレッジ比率						
15	算入可能適格流動性資産の合計額	2,668,457	2,915,526	2,704,014	2,283,165	2,282,828
16	純資金流出額	1,882,992	1,858,481	2,112,520	1,792,827	1,667,339
17	連結流動性カバレッジ比率	142.5%	157.6%	128.1%	128.2%	138.1%
連結安定調達比率						
18	利用可能安定調達額	3,508,947	3,661,306	3,534,899	3,492,895	3,528,155
19	所要安定調達額	2,987,921	3,156,617	3,069,023	3,131,223	3,115,172
20	連結安定調達比率	117.4%	115.9%	115.1%	111.5%	113.2%

注) 項番15～17には四半期平均値を記載しています。

みずほ信託銀行連結の自己資本の充実の状況

〔銀行法施行規則第19条の2第1項第5号二等の規定に基づき、自己資本の充実の状況等について金融庁長官が別に定める事項〕（平成26年金融庁告示第7号）に基づき開示しています。

■ 連結の範囲

(1) 連結自己資本比率の算出における連結の範囲

(A) 中間連結財務諸表規則に基づき連結の範囲(以下「会計連結範囲」)に含まれる会社との相違点

2022年度中間期、2023年度中間期とも、該当ありません。

(B) 連結子会社の数

	2022年度中間期	2023年度中間期
連結子会社	11社	10社

主要な連結子会社(及び主要な業務の内容)は、みずほ不動産販売株式会社(不動産仲介業務)、Mizuho Trust & Banking(Luxembourg)S.A.(信託業務、銀行業務)、みずほリアルティOne株式会社(持株会社)です。

(C) 自己資本比率告示第9条が適用される金融業務を営む関連法人等

2022年度中間期、2023年度中間期とも、該当ありません。

(D) 連結グループに属する会社であって会計連結範囲に含まれないもの及び連結グループに属しない会社であって会計連結範囲に含まれるもの

2022年度中間期、2023年度中間期とも、該当ありません。

(E) 連結グループ内の資金及び自己資本の移動に係る制限等

2022年度中間期、2023年度中間期とも、該当ありません。

(F) その他金融機関等であって銀行の子法人等であるもののうち、規制上の所要自己資本を下回った会社

2022年度中間期、2023年度中間期とも、該当ありません。

みずほ信託銀行連結の自己資本の充実の状況

■自己資本

(1) 自己資本の構成等

(A) CC1：自己資本の構成

(単位：百万円、%)

国際様式の 該当番号	項目	イ 2022年度 中間期	ロ 2023年度 中間期	ハ 別紙様式第十四号 (CC2) の参照項目
普通株式等Tier1資本に係る基礎項目 (1)				
1a+2-1c-26	普通株式に係る株主資本の額	466,431	469,534	
1a	うち資本金及び資本剰余金の額	265,195	265,195	
2	うち利益剰余金の額	281,235	284,339	
1c	うち自己株式の額(△)	79,999	79,999	
26	うち社外流出予定額(△)	—	—	
	うち上記以外に該当するものの額	—	—	
1b	普通株式に係る新株予約権の額	—	—	
3	その他の包括利益累計額及びその他公表準備金の額	84,464	128,205	(a)
5	普通株式等Tier1資本に係る調整後非支配株主持分の額	—	—	
6	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	(イ) 550,895	597,740	
普通株式等Tier1資本に係る調整項目 (2)				
8+9	無形固定資産(モーゲージ・サービシング・ライツに係るものを除く。)の額の合計額	26,102	24,696	
8	うちのれんに係るもの(のれん相当差額を含む。)の額	11,161	10,294	
9	うちのれん及びモーゲージ・サービシング・ライツに係るもの以外のものの額	14,941	14,402	
10	繰延税金資産(一時差異に係るものを除く。)の額	0	2	
11	繰延ヘッジ損益の額	4,546	10,367	
12	適格引当金不足額	1,447	2,259	
13	証券化取引に伴い増加した自己資本に相当する額	—	—	
14	負債の時価評価により生じた時価評価差額であって自己資本に算入される額	—	—	
15	退職給付に係る資産の額	65,468	88,906	
16	自己保有普通株式(純資産の部に計上されるものを除く。)の額	—	—	
17	意図的に保有している他の金融機関等の普通株式の額	—	—	
18	少数出資金融機関等の普通株式の額	—	—	
19+20+21	特定項目に係る10%基準超過額	—	—	
19	うちその他金融機関等に係る対象資本等調達手段のうち普通株式に該当するものに関するものの額	—	—	
20	うち無形固定資産(モーゲージ・サービシング・ライツに係るものに限る。)に関するものの額	—	—	
21	うち繰延税金資産(一時差異に係るものに限る。)に関するものの額	—	—	
22	特定項目に係る15%基準超過額	—	—	
23	うちその他金融機関等に係る対象資本等調達手段のうち普通株式に該当するものに関するものの額	—	—	
24	うち無形固定資産(モーゲージ・サービシング・ライツに係るものに限る。)に関するものの額	—	—	
25	うち繰延税金資産(一時差異に係るものに限る。)に関するものの額	—	—	
27	その他Tier1資本不足額	—	—	
28	普通株式等Tier1資本に係る調整項目の額	(ロ) 97,564	126,233	
普通株式等Tier1資本				
29	普通株式等Tier1資本の額((イ)-(ロ))	(ハ) 453,330	471,507	

(次ページへ続く)

(続き)

(単位：百万円、%)

国際様式の 該当番号	項目		イ 2022年度 中間期	ロ 2023年度 中間期	ハ 別紙様式第十四号 (CC2)の参照項目
その他Tier1資本に係る基礎項目		(3)			
30 31a	その他Tier1資本調達手段に係る株主資本の額及びその内訳		—	—	
30 31b	その他Tier1資本調達手段に係る新株予約権の額		—	—	
30 32	その他Tier1資本調達手段に係る負債の額		—	—	
30	特別目的会社等の発行するその他Tier1資本調達手段の額		—	—	
34-35	その他Tier1資本に係る調整後非支配株主持分等の額		14	17	
33+35	適格旧Tier1資本調達手段の額のうちその他Tier1資本に係る基礎項目の額に含まれる額		/	/	
33	うち銀行及び銀行の特別目的会社等の発行する資本調達手段の額		/	/	
35	うち銀行の連結子法人等(銀行の特別目的会社等を除く。)の発行する資本調達手段の額		/	/	
36	その他Tier1資本に係る基礎項目の額	(二)	14	17	
その他Tier1資本に係る調整項目					
37	自己保有その他Tier1資本調達手段の額		—	—	
38	意図的に保有している他の金融機関等のその他Tier1資本調達手段の額		—	—	
39	少数出資金融機関等のその他Tier1資本調達手段の額		—	—	
40	その他金融機関等のその他Tier1資本調達手段の額		—	—	
42	Tier2資本不足額		—	—	
43	その他Tier1資本に係る調整項目の額	(ホ)	—	—	
その他Tier1資本					
44	その他Tier1資本の額((二)-(ホ))	(ヘ)	14	17	
Tier1資本					
45	Tier1資本の額((イ)+(ヘ))	(ト)	453,345	471,524	
Tier2資本に係る基礎項目		(4)			
46	Tier2資本調達手段に係る株主資本の額及びその内訳		—	—	
46	Tier2資本調達手段に係る新株予約権の額		—	—	
46	Tier2資本調達手段に係る負債の額		—	—	
46	特別目的会社等の発行するTier2資本調達手段の額		—	—	
48-49	Tier2資本に係る調整後非支配株主持分等の額		3	4	
47+49	適格旧Tier2資本調達手段の額のうちTier2資本に係る基礎項目の額に含まれる額		/	/	
47	うち銀行及び銀行の特別目的会社等の発行する資本調達手段の額		/	/	
49	うち銀行の連結子法人等(銀行の特別目的会社等を除く。)の発行する資本調達手段の額		/	/	
50	一般貸倒引当金Tier2算入額及び適格引当金Tier2算入額の合計額		52	148	
50a	うち一般貸倒引当金Tier2算入額		52	148	
50b	うち適格引当金Tier2算入額		—	—	
51	Tier2資本に係る基礎項目の額	(チ)	56	152	

(次ページへ続く)

みずほ信託銀行連結の自己資本の充実の状況

(続き)

(単位：百万円、%)

国際様式の 該当番号	項目		イ 2022年度 中間期	ロ 2023年度 中間期	ハ 別紙様式第十四号 (CC2) の参照項目
Tier2資本に係る調整項目 (5)					
52	自己保有Tier2資本調達手段の額		—	—	
53	意図的に保有している他の金融機関等のTier2資本調達手段及びその他外部TLAC関連調達手段の額		—	—	
54	少数出資金融機関等のTier2資本調達手段及びその他外部TLAC関連調達手段の額		—	—	
55	その他金融機関等のTier2資本調達手段及びその他外部TLAC関連調達手段の額		—	—	
57	Tier2資本に係る調整項目の額	(リ)	—	—	
Tier2資本					
58	Tier2資本の額((チ)-(リ))	(ヌ)	56	152	
総自己資本					
59	総自己資本の額((ト)+(ヌ))	(ル)	453,401	471,676	
リスク・アセット (6)					
60	リスク・アセットの額	(ヲ)	1,702,856	1,659,176	
連結自己資本比率 (7)					
61	連結普通株式等Tier1比率((ハ)/(ヲ))		26.62%	28.41%	
62	連結Tier1比率((ト)/(ヲ))		26.62%	28.41%	
63	連結総自己資本比率((ル)/(ヲ))		26.62%	28.42%	
調整項目に係る参考事項 (8)					
72	少数出資金融機関等の対象資本等調達手段に係る調整項目不算入額		8,013	10,724	
73	その他金融機関等に係る対象資本等調達手段のうち普通株式に係る調整項目不算入額		1,879	1,644	
74	無形固定資産(モーゲージ・サービシング・ライツに係るものに限る。)に係る調整項目不算入額		—	—	
75	繰延税金資産(一時差異に係るものに限る。)に係る調整項目不算入額		5,391	929	
Tier2資本に係る基礎項目の額に算入される引当金に関する事項 (9)					
76	一般貸倒引当金の額		52	148	
77	一般貸倒引当金に係るTier2資本算入上限額		961	1,355	
78	内部格付手法採用行において、適格引当金の合計額から事業法人等向けエクスポージャー及びリテール向けエクスポージャーの期待損失額の合計額を控除した額(当該額が零を下回る場合にあっては、零とする。)		—	—	
79	適格引当金に係るTier2資本算入上限額		7,844	7,345	
資本調達手段に係る経過措置に関する事項 (10)					
82	適格旧Tier1資本調達手段に係る算入上限額		/	/	
83	適格旧Tier1資本調達手段の額から適格旧Tier1資本調達手段に係る算入上限額を控除した額(当該額が零を下回る場合にあっては、零とする。)		/	/	
84	適格旧Tier2資本調達手段に係る算入上限額		/	/	
85	適格旧Tier2資本調達手段の額から適格旧Tier2資本調達手段に係る算入上限額を控除した額(当該額が零を下回る場合にあっては、零とする。)		/	/	

注) 1. 上記は「銀行法第14条の2の規定に基づき、銀行がその保有する資産等に照らし自己資本の充実の状況が適当であるかどうかを判断するための基準」(平成18年金融庁告示第19号。以下、「告示」という。)に基づいて算出したものであり、国際統一基準を採用した連結ベースの計数となっております。
 2. 当行は、連結自己資本比率の算定に関する外部監査として、日本公認会計士協会専門業務実務指針 4465「自己資本比率及びレバレッジ比率の算定に対する合意された手続業務に関する実務指針」に基づく合意された手続業務を、EY新日本有限責任監査法人により受けています。なお、当該業務は、連結財務諸表の監査又は財務報告に係る内部統制の監査の一部ではありません。当該業務は自己資本比率そのものや自己資本比率の算定に係る内部管理体制について意見又は結論を表明するものではなく、当行と合意した範囲において手続をEY新日本有限責任監査法人が実施し、当行に対しその結果を報告するものです。

(B) CC2：中間連結貸借対照表の科目と自己資本の構成に関する開示項目の対応関係

(単位：百万円)

項目	(単位：百万円)		八 別紙様式第五号を参照 する番号又は記号	二 付表を参照する 番号又は記号
	イ 公表 中間連結貸借対照表 2022年度中間期	ロ 公表 中間連結貸借対照表 2023年度中間期		
(資産の部)				
現金預け金	2,334,486	2,576,430		
債券貸借取引支払保証金	20,038	40,318		
買入金銭債権	41,199	39,541		
金銭の信託	28,154	26,001		
有価証券	284,094	282,719		2-b, 6-b
貸出金	3,132,916	2,936,138		6-c
外国為替	4,139	5,472		
その他資産	266,916	239,116		6-d
有形固定資産	102,092	93,485		
無形固定資産	32,203	30,500		2-a
退職給付に係る資産	94,361	128,144		3
繰延税金資産	466	766		4-a
支払承諾見返	13,575	13,909		
貸倒引当金	△2,428	△2,734		
資産の部合計	6,352,217	6,409,811		
(負債の部)				
預金	2,667,106	2,895,583		
譲渡性預金	702,680	385,550		
コールマネー及び売渡手形	908,714	1,008,231		
借入金	300,000	326,100		8-a
外国為替	73	—		
信託勘定借	1,138,586	1,083,338		
その他負債	35,256	45,365		6-f
賞与引当金	3,030	3,218		
変動報酬引当金	123	136		
退職給付に係る負債	1,068	1,124		
役員退職慰労引当金	130	169		
睡眠預金払戻損失引当金	830	594		
繰延税金負債	30,069	48,643		4-b
支払承諾	13,575	13,909		
負債の部合計	5,801,244	5,811,966		
(純資産の部)				
資本金	247,369	247,369		1-a
資本剰余金	17,825	17,825		1-b
利益剰余金	281,235	284,339		1-c
自己株式	△79,999	△79,999		1-d
株主資本合計	466,431	469,534		
その他有価証券評価差額金	56,714	75,875		
繰延ヘッジ損益	4,546	10,367		5
為替換算調整勘定	3,941	4,849		
退職給付に係る調整累計額	19,261	37,112		
その他の包括利益累計額合計	84,464	128,205	(a)	
非支配株主持分	77	104		7
純資産の部合計	550,972	597,844		
負債及び純資産の部合計	6,352,217	6,409,811		

注) 規制上の連結の範囲と会計上の連結の範囲は同一であります。

みずほ信託銀行連結の自己資本の充実の状況

〈付表〉

1. 株主資本

①中間連結貸借対照表

(単位：百万円)

参照番号	中間連結貸借対照表科目	2022年度 中間期	2023年度 中間期	備考
1-a	資本金	247,369	247,369	
1-b	資本剰余金	17,825	17,825	
1-c	利益剰余金	281,235	284,339	
1-d	自己株式	△79,999	△79,999	
	株主資本合計	466,431	469,534	

②自己資本の構成

(単位：百万円)

国際様式の 該当番号	自己資本の構成に関する開示事項	2022年度 中間期	2023年度 中間期	備考
	普通株式等Tier1資本に係る額	466,431	469,534	普通株式に係る株主資本(社外流出予定額調整前)
1a	うち資本金及び資本剰余金の額	265,195	265,195	
2	うち利益剰余金の額	281,235	284,339	
1c	うち自己株式の額(△)	79,999	79,999	
	うち上記以外に該当するものの額	—	—	
31a	その他Tier1資本調達手段に係る額	—	—	

2. 無形固定資産

①中間連結貸借対照表

(単位：百万円)

参照番号	中間連結貸借対照表科目	2022年度 中間期	2023年度 中間期	備考
2-a	無形固定資産	32,203	30,500	
2-b	有価証券	284,094	282,719	
	うち持分法適用会社に係るのれん相当額	—	—	持分法適用会社に係るのれん相当額
	上記に係る税効果	△6,100	△5,803	

②自己資本の構成

(単位：百万円)

国際様式の 該当番号	自己資本の構成に関する開示事項	2022年度 中間期	2023年度 中間期	備考
8	無形固定資産 のれんに係るもの	11,161	10,294	
9	無形固定資産 その他の無形固定資産	14,941	14,402	のれん、モーゲージ・サービシング・ライセンス以外(ソフトウェア等)
	無形固定資産 モーゲージ・サービシング・ライセンス	—	—	
20	特定項目に係る10%基準超過額	—	—	
24	特定項目に係る15%基準超過額	—	—	
74	無形固定資産(モーゲージ・サービシング・ライセンスに係るものに限る。)に係る調整項目不算入額	—	—	

3. 退職給付に係る資産

①中間連結貸借対照表

(単位：百万円)

参照番号	中間連結貸借対照表科目	2022年度 中間期	2023年度 中間期	備考
3	退職給付に係る資産	94,361	128,144	
	上記に係る税効果	△28,893	△39,237	

②自己資本の構成

(単位：百万円)

国際様式の 該当番号	自己資本の構成に関する開示事項	2022年度 中間期	2023年度 中間期	備考
15	退職給付に係る資産の額	65,468	88,906	

4. 繰延税金資産

①中間連結貸借対照表

(単位：百万円)

参照番号	中間連結貸借対照表科目	2022年度 中間期	2023年度 中間期	備考
4-a	繰延税金資産	466	766	
4-b	繰延税金負債	30,069	48,643	
	無形固定資産の税効果勘案分	6,100	5,803	
	退職給付に係る資産の税効果勘案分	28,893	39,237	

②自己資本の構成

(単位：百万円)

国際様式の 該当番号	自己資本の構成に関する開示事項	2022年度 中間期	2023年度 中間期	備考
10	繰延税金資産(一時差異に係るものを除く。)	0	2	資産負債相殺処理等のため、連結貸借対照表計上額とは一致せず
	一時差異に係る繰延税金資産	5,391	929	資産負債相殺処理等のため、連結貸借対照表計上額とは一致せず
21	特定項目に係る10%基準超過額	—	—	
25	特定項目に係る15%基準超過額	—	—	
75	繰延税金資産(一時差異に係るものに限る。)に係る調整項目不算入額	5,391	929	

5. 繰延ヘッジ損益

①中間連結貸借対照表

(単位：百万円)

参照番号	中間連結貸借対照表科目	2022年度 中間期	2023年度 中間期	備考
5	繰延ヘッジ損益	4,546	10,367	

②自己資本の構成

(単位：百万円)

国際様式の 該当番号	自己資本の構成に関する開示事項	2022年度 中間期	2023年度 中間期	備考
11	繰延ヘッジ損益の額	4,546	10,367	ヘッジ対象に係る時価評価差額が「その他の包括利益累計額合計」として計上されているものを除いたもの

みずほ信託銀行連結の自己資本の充実の状況

6. 金融機関向け出資等の対象科目

①中間連結貸借対照表

(単位：百万円)

参照番号	中間連結貸借対照表科目	2022年度 中間期	2023年度 中間期	備考
	特定取引資産	—	—	
6-b	有価証券	284,094	282,719	
6-c	貸出金	3,132,916	2,936,138	
6-d	その他資産	266,916	239,116	金融派生商品、出資金等を含む
	特定取引負債	—	—	
6-f	その他負債	35,256	45,365	金融派生商品等を含む

②自己資本の構成

(単位：百万円)

国際様式の 該当番号	自己資本の構成に関する開示事項	2022年度 中間期	2023年度 中間期	備考
	自己保有資本調達手段の額	—	—	
16	普通株式等Tier1相当額	—	—	
37	その他Tier1相当額	—	—	
52	Tier2相当額	—	—	
	意図的に保有している他の金融機関等の資本 調達手段の額	—	—	
17	普通株式等Tier1相当額	—	—	
38	その他Tier1相当額	—	—	
53	Tier2相当額及びその他外部TLAC関連調達 手段の額	—	—	
	少数出資金融機関等の資本調達手段の額	8,013	10,724	
18	普通株式等Tier1相当額	—	—	
39	その他Tier1相当額	—	—	
54	Tier2相当額及びその他外部TLAC関連調達 手段の額	—	—	
72	少数出資金融機関等の対象資本等調達手段に 係る調整項目不算入額	8,013	10,724	
	その他金融機関等(10%超出資)	1,879	1,644	
19	特定項目に係る10%基準超過額	—	—	
23	特定項目に係る15%基準超過額	—	—	
40	その他Tier1相当額	—	—	
55	Tier2相当額及びその他外部TLAC関連調達 手段の額	—	—	
73	その他金融機関等に係る対象資本等調達手段 のうち普通株式に係る調整項目不算入額	1,879	1,644	

7. 非支配株主持分

①中間連結貸借対照表

(単位：百万円)

参照番号	中間連結貸借対照表科目	2022年度 中間期	2023年度 中間期	備考
7	非支配株主持分	77	104	

②自己資本の構成

(単位：百万円)

国際様式の 該当番号	自己資本の構成に関する開示事項	2022年度 中間期	2023年度 中間期	備考
5	普通株式等Tier1資本に係る額	—	—	算入可能額(調整後非支配株主持分)勘案後
30-31ab-32	特別目的会社等の発行するその他Tier1資本 調達手段の額	—	—	算入可能額(調整後非支配株主持分)勘案後
34-35	その他Tier1資本に係る額	14	17	算入可能額(調整後非支配株主持分)勘案後
46	特別目的会社等の発行するTier2資本調達手 段の額	—	—	算入可能額(調整後非支配株主持分)勘案後
48-49	Tier2資本に係る額	3	4	算入可能額(調整後非支配株主持分)勘案後

8. その他資本調達

①中間連結貸借対照表

(単位：百万円)

参照番号	中間連結貸借対照表科目	2022年度 中間期	2023年度 中間期	備考
8-a	借入金	300,000	326,100	
	社債	—	—	
	合計	300,000	326,100	

②自己資本の構成

(単位：百万円)

国際様式の 該当番号	自己資本の構成に関する開示事項	2022年度 中間期	2023年度 中間期	備考
32	その他Tier1資本調達手段に係る負債の額	—	—	
46	Tier2資本調達手段に係る負債の額	—	—	

みずほ信託銀行連結の自己資本の充実の状況

■リスク・アセットの概要

(A) OV1：リスク・アセットの概要

(単位：百万円)

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			
		2023年度中間期	2022年度中間期	2023年度中間期	2022年度中間期	2023年度中間期	2022年度中間期	2023年度中間期	2022年度中間期
1	信用リスク	1,072,747	1,116,712	89,988	93,837				
2	うち、標準的手法適用分	20,705	34,803	1,656	2,784				
3	うち、内部格付手法適用分	868,387	937,683	73,639	79,515				
	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	183,654	144,226	14,692	11,538				
4	カウンターパーティ信用リスク	722	849	57	68				
5	うち、SA-CCR適用分	—	—	—	—				
	うち、カレント・エクスポージャー方式適用分	—	—	—	—				
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	—	—	—	—				
	うち、CVAリスク	—	—	—	—				
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	705	845	56	67				
	その他	17	4	1	0				
7	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	138,942	140,389	11,782	11,905				
8	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)	43,543	36,177	3,628	3,016				
9	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%)	—	—	—	—				
	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%)	3,015	3,008	255	255				
10	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%)	2,982	2,474	238	197				
11	未決済取引	—	—	—	—				
12	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	2,302	659	184	52				
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	2,302	659	184	52				
14	うち、外部格付準拠方式適用分	—	—	—	—				
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	—	—	—	—				
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	—	—	—	—				
16	マーケット・リスク	1,081	1,176	86	94				
17	うち、標準的方式適用分	1,081	1,176	86	94				
18	うち、内部モデル方式適用分	—	—	—	—				
19	オペレーショナル・リスク	324,730	316,552	25,978	25,324				
20	うち、基礎的手法適用分	56,226	50,432	4,498	4,034				
21	うち、粗利益配分手法適用分	—	—	—	—				
22	うち、先進的計測手法適用分	268,504	266,119	21,480	21,289				
23	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	6,432	18,175	534	1,476				
	経過措置によりリスク・アセットの額に算入されるものの額	—	—	—	—				
24	フロア調整	—	—	—	—				
25	合計(スケーリング・ファクター勘案後)	1,659,176	1,702,856	132,734	136,228				

■信用リスク

(1) 信用リスクに関する定量的開示事項

カウンターパーティ信用リスク、証券化エクスポージャー、信用リスク・アセットのみなし計算が適用されるエクスポージャーを除いています。

(A) CR1：資産の信用の質

(単位：百万円)

項番	2022年度中間期				
	イ	ロ	ハ	ニ	
	帳簿価額 デフォルトした エクスポージャー	額の総額 非デフォルト エクスポージャー	引当金	ネット金額 (イ+ロ-ハ)	
オン・バランスシートの資産					
1	貸出金	11,174	3,120,241	2,281	3,129,134
2	有価証券(うち負債性のもの)	—	123,855	—	123,855
3	その他オン・バランスシートの資産(うち負債性のもの)	—	2,399,057	6	2,399,050
4	オン・バランスシートの資産の合計 (1+2+3)	11,174	5,643,155	2,288	5,652,040
オフ・バランスシートの資産					
5	支払承諾等	—	13,575	12	13,562
6	コミットメント等	150	390,700	—	390,850
7	オフ・バランスシートの資産の合計 (5+6)	150	404,275	12	404,413
合計					
8	合計 (4+7)	11,324	6,047,431	2,301	6,056,453

注) 1. その他オン・バランスシートの資産(うち負債性のもの)には預け金、コールローン、買入手形、買入金銭債権、金銭の信託、外国為替等が含まれます。
2. デフォルトしたエクスポージャーには貸出条件緩和債権、3カ月以上延滞債権、破綻先債権等が含まれます。
3. 引当金は貸倒引当金の金額です。

(単位：百万円)

項番	2023年度中間期				
	イ	ロ	ハ	ニ	
	帳簿価額 デフォルトした エクスポージャー	額の総額 非デフォルト エクスポージャー	引当金	ネット金額 (イ+ロ-ハ)	
オン・バランスシートの資産					
1	貸出金	18,056	2,916,582	2,583	2,932,055
2	有価証券(うち負債性のもの)	—	102,450	—	102,450
3	その他オン・バランスシートの資産(うち負債性のもの)	—	2,638,815	6	2,638,808
4	オン・バランスシートの資産の合計 (1+2+3)	18,056	5,657,848	2,590	5,673,314
オフ・バランスシートの資産					
5	支払承諾等	—	13,909	12	13,897
6	コミットメント等	60	373,497	—	373,557
7	オフ・バランスシートの資産の合計 (5+6)	60	387,407	12	387,454
合計					
8	合計 (4+7)	18,116	6,045,255	2,602	6,060,768

注) 1. その他オン・バランスシートの資産(うち負債性のもの)には預け金、コールローン、買入手形、買入金銭債権、金銭の信託、外国為替等が含まれます。
2. デフォルトしたエクスポージャーには貸出条件緩和債権、3カ月以上延滞債権、破綻先債権等が含まれます。
3. 引当金は貸倒引当金の金額です。

みずほ信託銀行連結の自己資本の充実の状況

(B) CR2：デフォルトした貸出金・有価証券等(うち負債性のもの)の残高の変動

(単位：百万円)

		2022年度中間期
項番		額
1	2021年度末時点においてデフォルト状態にある貸出金・有価証券等(うち負債性のもの)の残高	16,307
2		デフォルトした額
		284
3		非デフォルト状態へ復帰した額
		2,136
4	貸出金・有価証券等(うち負債性のもの)の当中間期中の要因別の変動額	償却された額
		—
5		その他の変動額
		△3,280
6	2022年度中間期末時点においてデフォルト状態にある貸出金・有価証券等(うち負債性のもの)の残高 (1+2-3-4+5)	11,174

注) その他の変動額はデフォルト状態にあるエクスポージャーの回収による残高減少、デフォルト期間中の追加与信等によるものです。

(単位：百万円)

		2023年度中間期
項番		額
1	2022年度末時点においてデフォルト状態にある貸出金・有価証券等(うち負債性のもの)の残高	21,010
2		デフォルトした額
		335
3		非デフォルト状態へ復帰した額
		1,145
4	貸出金・有価証券等(うち負債性のもの)の当中間期中の要因別の変動額	償却された額
		—
5		その他の変動額
		△2,143
6	2023年度中間期末時点においてデフォルト状態にある貸出金・有価証券等(うち負債性のもの)の残高 (1+2-3-4+5)	18,056

注) その他の変動額はデフォルト状態にあるエクスポージャーの回収による残高減少、デフォルト期間中の追加与信等によるものです。

(2) 内部格付手法における信用リスク

(i) 内部格付手法に関する定量的開示事項

(A) CR6：内部格付手法－ポートフォリオ及びデフォルト率(PD)区分別の信用リスク・エクスポージャー (単位：百万円、%、千件、年)

2022年度中間期													
項番	PD 区分	イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ	ト	チ	リ	ヌ	ル	ヲ
		オン・バランス シート・グロス エクスポージャー の額	CCF・信用リスク 削減手法適用前 のオフ・バランス シート・エク スポージャーの額	平均CCF	CCF・信用 リスク削減 手法適用後 EAD	平均PD	債務者の数	平均LGD	平均残存期間	信用リスク・ アセットの額	リスク・ウェイト の加重平均値 (RWA density)	EL	適格引当金
ソブリン向けエクスポージャー													
1	0.00以上0.15未満	2,194,872	7	—	2,201,199	0.00	0.0	37.60	0.0	2,107	0.09	1	／
2	0.15以上0.25未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	／
3	0.25以上0.50未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	／
4	0.50以上0.75未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	／
5	0.75以上2.50未満	9	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	／
6	2.50以上10.00未満	5	—	—	0	5.50	0.0	37.61	1.2	0	116.94	0	／
7	10.00以上100.00未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	／
8	100.00(デフォルト)	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	／
9	小計	2,194,887	7	—	2,201,199	0.00	0.0	37.60	0.0	2,108	0.09	1	1
金融機関等向けエクスポージャー													
1	0.00以上0.15未満	164,078	56	100.00	164,134	0.03	0.0	37.61	1.4	18,669	11.37	19	／
2	0.15以上0.25未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	／
3	0.25以上0.50未満	0	—	—	0	0.41	0.0	37.61	0.0	0	30.06	0	／
4	0.50以上0.75未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	／
5	0.75以上2.50未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	／
6	2.50以上10.00未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	／
7	10.00以上100.00未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	／
8	100.00(デフォルト)	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	／
9	小計	164,078	56	100.00	164,135	0.03	0.0	37.61	1.4	18,669	11.37	19	11
事業法人向けエクスポージャー(中堅中小企業向けエクスポージャー及び特定貸付債権を除く。)													
1	0.00以上0.15未満	1,920,396	412,380	69.88	2,219,503	0.05	0.4	38.09	2.7	402,899	18.15	438	／
2	0.15以上0.25未満	104,359	15,194	31.29	104,519	0.19	0.0	35.62	2.3	34,947	33.43	71	／
3	0.25以上0.50未満	21,675	623	50.95	21,808	0.41	0.0	33.04	1.6	9,316	42.72	29	／
4	0.50以上0.75未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	／
5	0.75以上2.50未満	43,182	4,266	96.22	47,249	1.32	0.0	30.48	2.1	28,767	60.88	172	／
6	2.50以上10.00未満	19,434	700	21.42	16,974	3.93	0.0	16.67	3.1	9,164	53.99	133	／
7	10.00以上100.00未満	9,555	—	—	9,555	13.00	0.0	19.40	2.0	8,417	88.09	241	／
8	100.00(デフォルト)	2,432	150	75.00	2,545	100.00	0.0	20.64	1.4	586	23.03	478	／
9	小計	2,121,036	433,315	68.69	2,422,156	0.26	0.6	37.55	2.6	494,100	20.39	1,565	959
中堅中小企業向けエクスポージャー													
1	0.00以上0.15未満	10,297	1,000	—	10,297	0.10	0.0	36.58	3.4	2,852	27.70	3	／
2	0.15以上0.25未満	15,892	343	9.40	15,924	0.19	0.0	19.41	3.6	2,625	16.48	5	／
3	0.25以上0.50未満	26,800	1,894	92.40	28,551	0.41	0.1	9.50	4.5	3,720	13.02	11	／
4	0.50以上0.75未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	／
5	0.75以上2.50未満	108,802	4,633	98.35	113,359	1.13	0.5	7.63	4.9	18,542	16.35	98	／
6	2.50以上10.00未満	51,931	1,143	79.65	49,143	2.72	0.1	8.88	4.9	11,578	23.56	118	／
7	10.00以上100.00未満	2,275	—	—	2,275	13.00	0.0	7.32	4.7	677	29.76	21	／
8	100.00(デフォルト)	410	—	—	410	100.00	0.0	64.75	4.7	123	30.08	255	／
9	小計	216,410	9,014	80.43	219,962	1.58	0.9	10.46	4.7	40,120	18.23	515	315
特定貸付債権													
1	0.00以上0.15未満	693,702	9,444	75.00	700,796	0.06	0.1	29.63	4.1	144,751	20.65	130	／
2	0.15以上0.25未満	2,851	—	—	2,851	0.19	0.0	28.71	3.2	895	31.38	1	／
3	0.25以上0.50未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	／
4	0.50以上0.75未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	／
5	0.75以上2.50未満	4,000	—	—	4,000	2.15	0.0	28.71	5.0	3,800	95.02	24	／
6	2.50以上10.00未満	2,305	—	—	2,305	2.71	0.0	37.61	5.0	3,008	130.51	23	／
7	10.00以上100.00未満	2,704	—	—	2,704	13.00	0.0	31.31	1.0	3,680	136.08	110	／
8	100.00(デフォルト)	6,764	—	—	6,764	100.00	0.0	53.04	5.0	389	57.62	327	／
9	小計	712,329	9,444	75.00	713,324	0.22	0.1	29.68	4.1	156,527	21.94	618	378
株式等エクスポージャー(PD/LGD方式が適用されるエクスポージャー)													
1	0.00以上0.15未満	139,976	—	—	139,976	0.05	0.2	90.00	5.0	141,026	100.74	／	／
2	0.15以上0.25未満	6,683	—	—	6,683	0.19	0.0	90.00	5.0	9,175	137.28	／	／
3	0.25以上0.50未満	1,916	—	—	1,916	0.41	0.0	90.00	5.0	3,632	189.49	／	／
4	0.50以上0.75未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	／	／
5	0.75以上2.50未満	4,103	—	—	4,103	1.16	0.0	90.00	5.0	11,032	268.84	／	／
6	2.50以上10.00未満	1,352	—	—	1,352	4.35	0.0	90.00	5.0	5,340	394.88	／	／
7	10.00以上100.00未満	421	—	—	421	13.00	0.0	90.00	5.0	2,641	626.18	／	／
8	100.00(デフォルト)	53	—	—	53	100.00	0.0	90.00	5.0	599	1,125.00	／	／
9	小計	154,508	—	—	154,508	0.19	0.4	90.00	5.0	173,448	112.25	／	／

(次ページへ続く)

みずほ信託銀行連結の自己資本の充実の状況

(続き)

(単位：百万円、%、千件、年)

		2022年度中間期											
項番	PD 区分	イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ	ト	チ	リ	ヌ	ル	ヲ
		オン・バランスシート・グロスエクスポージャーの額	CCF・信用リスク削減手法適用前のオフ・バランスシート・エクスポージャーの額	平均CCF	CCF・信用リスク削減手法適用後のEAD	平均PD	債務者の数	平均LGD	平均残存期間	信用リスク・アセットの額	リスクウェイトの加重平均値(RWA density)	EL	適格引当金
購入債権(事業法人等向け) - デフォルト・リスク相当分													
1	0.00以上0.15未満	21,991	-	-	21,747	0.03	0.0	37.61	0.0	828	3.80	3	/
2	0.15以上0.25未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	/
3	0.25以上0.50未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	/
4	0.50以上0.75未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	/
5	0.75以上2.50未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	/
6	2.50以上10.00未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	/
7	10.00以上100.00未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	/
8	100.00(デフォルト)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	/
9	小計	21,991	-	-	21,747	0.03	0.0	37.61	0.0	828	3.80	3	1
購入債権(リテール向け) - デフォルト・リスク相当分													
1	0.00以上0.15未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	/
2	0.15以上0.25未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	/
3	0.25以上0.50未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	/
4	0.50以上0.75未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	/
5	0.75以上2.50未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	/
6	2.50以上10.00未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	/
7	10.00以上100.00未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	/
8	100.00(デフォルト)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	/
9	小計	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
購入債権(希薄化リスク相当分)													
1	0.00以上0.15未満	18,024	-	-	18,024	0.03	0.0	32.32	-	1,382	7.66	2	/
2	0.15以上0.25未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	/
3	0.25以上0.50未満	3,967	-	-	3,967	0.41	0.0	32.32	-	1,561	39.36	6	/
4	0.50以上0.75未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	/
5	0.75以上2.50未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	/
6	2.50以上10.00未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	/
7	10.00以上100.00未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	/
8	100.00(デフォルト)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	/
9	小計	21,991	-	-	21,991	0.10	0.0	32.32	-	2,943	13.38	8	/
適格リボルピング型リテール向けエクスポージャー													
1	0.00以上0.15未満	-	-	-	-	-	-	-	/	-	-	-	/
2	0.15以上0.25未満	-	-	-	-	-	-	-	/	-	-	-	/
3	0.25以上0.50未満	-	-	-	-	-	-	-	/	-	-	-	/
4	0.50以上0.75未満	-	-	-	-	-	-	-	/	-	-	-	/
5	0.75以上2.50未満	-	-	-	-	-	-	-	/	-	-	-	/
6	2.50以上10.00未満	-	-	-	-	-	-	-	/	-	-	-	/
7	10.00以上100.00未満	-	-	-	-	-	-	-	/	-	-	-	/
8	100.00(デフォルト)	-	-	-	-	-	-	-	/	-	-	-	/
9	小計	-	-	-	-	-	-	-	/	-	-	-	-
居住用不動産向けエクスポージャー													
1	0.00以上0.15未満	212	-	-	212	0.10	0.2	43.43	/	21	10.25	0	/
2	0.15以上0.25未満	536	-	-	536	0.21	0.2	43.43	/	99	18.54	0	/
3	0.25以上0.50未満	14,818	-	-	14,818	0.33	1.7	43.43	/	3,767	25.42	21	/
4	0.50以上0.75未満	11,491	-	-	11,491	0.62	1.6	43.43	/	4,542	39.53	31	/
5	0.75以上2.50未満	17,225	-	-	17,225	0.93	0.5	43.43	/	8,969	52.07	70	/
6	2.50以上10.00未満	463	-	-	463	8.97	0.0	43.43	/	874	188.59	18	/
7	10.00以上100.00未満	310	-	-	310	53.20	0.0	43.43	/	596	192.14	71	/
8	100.00(デフォルト)	709	-	-	709	100.00	0.0	45.91	/	470	66.24	288	/
9	小計	45,767	-	-	45,767	2.62	4.4	43.47	/	19,342	42.26	501	307
その他リテール向けエクスポージャー													
1	0.00以上0.15未満	19	-	-	19	0.09	0.0	56.06	/	2	12.24	0	/
2	0.15以上0.25未満	28	-	-	28	0.18	0.0	43.43	/	4	16.78	0	/
3	0.25以上0.50未満	99,870	24	100.00	99,894	0.31	2.7	49.42	/	27,010	27.03	156	/
4	0.50以上0.75未満	795	-	-	795	0.70	0.7	79.94	/	550	69.18	4	/
5	0.75以上2.50未満	1,333	-	-	1,333	1.69	0.3	43.43	/	713	53.46	9	/
6	2.50以上10.00未満	315	-	-	315	3.04	0.4	-	/	-	-	-	/
7	10.00以上100.00未満	329	-	-	329	26.12	0.0	61.58	/	448	136.28	51	/
8	100.00(デフォルト)	1,031	-	-	1,031	100.00	0.0	56.51	/	862	83.65	513	/
9	小計	103,724	24	100.00	103,749	1.41	4.5	49.54	/	29,593	28.52	736	451
合計(全てのポートフォリオ)		5,756,726	451,862	69.06	6,068,542	0.24	11.0	37.23	1.9	937,683	15.45	3,970	2,428

注) 1. カウンターパーティ信用リスク、証券化エクスポージャー、信用リスク・アセットのみならず計算が適用されるエクスポージャーを除いています。
 2. オン・バランスシート・グロスエクスポージャーの額、CCF・信用リスク削減手法適用前のオフ・バランスシート・エクスポージャーの額、平均CCFは信用リスク削減手法適用前のPD推計値に基づき、PD区分に割り当てています。
 3. 債務者の数は、適格リボルピング型リテール向けエクスポージャー、居住用不動産向けエクスポージャー、その他リテール向けエクスポージャー(事業性・信を除く)においては、債権の数を開示しています。

(単位：百万円、%、千件、年)

項番	PD 区分	2023年度中間期											
		イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ	ト	チ	リ	ヌ	ル	ヲ
		オン・バランス シート・グロス エクスポージャー の額	CCF・信用リスク 削減手法適用前 のオフ・バランス シート・エク スポージャーの額	平均CCF	CCF・信用 リスク削減 手法適用後 EAD	平均PD	債務者の数	平均LGD	平均残存期間	信用リスク・ アセットの額	リスク・ウェイト の加重平均値 (RWA density)	EL	適格引当金
ソブリン向けエクスポージャー													
1	0.00以上0.15未満	2,446,164	7	—	2,451,726	0.00	0.0	37.03	0.0	1,584	0.06	1	／
2	0.15以上0.25未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	／
3	0.25以上0.50未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	／
4	0.50以上0.75未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	／
5	0.75以上2.50未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	／
6	2.50以上10.00未満	9	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	／
7	10.00以上100.00未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	／
8	100.00(デフォルト)	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	／
9	小計	2,446,173	7	—	2,451,726	0.00	0.0	37.03	0.0	1,584	0.06	1	0
金融機関等向けエクスポージャー													
1	0.00以上0.15未満	122,736	1,039	3.75	122,775	0.03	0.0	37.03	1.2	12,873	10.48	14	／
2	0.15以上0.25未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	／
3	0.25以上0.50未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	／
4	0.50以上0.75未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	／
5	0.75以上2.50未満	0	—	—	0	0.77	0.0	37.03	0.0	0	43.55	0	／
6	2.50以上10.00未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	／
7	10.00以上100.00未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	／
8	100.00(デフォルト)	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	／
9	小計	122,736	1,039	3.75	122,775	0.03	0.0	37.03	1.2	12,873	10.48	14	7
事業法人向けエクスポージャー(中堅中小企業向けエクスポージャー及び特定貸付債権を除く。)													
1	0.00以上0.15未満	1,830,031	408,029	68.78	2,121,393	0.05	0.4	37.37	2.8	379,046	17.86	401	／
2	0.15以上0.25未満	101,658	7,601	64.14	101,819	0.18	0.0	35.30	1.8	29,176	28.65	68	／
3	0.25以上0.50未満	20,571	798	28.05	20,654	0.41	0.0	31.94	1.5	8,079	39.11	27	／
4	0.50以上0.75未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	／
5	0.75以上2.50未満	32,303	4,611	85.87	36,224	1.18	0.0	30.26	2.1	21,257	58.68	118	／
6	2.50以上10.00未満	36,328	6,350	73.81	35,207	3.05	0.0	33.61	1.4	35,218	100.02	364	／
7	10.00以上100.00未満	3,012	—	—	3,012	12.97	0.0	27.07	2.5	3,927	130.39	105	／
8	100.00(デフォルト)	10,495	60	75.00	10,540	100.00	0.0	18.58	2.4	2,242	21.27	1,779	／
9	小計	2,034,401	427,450	68.89	2,328,852	0.59	0.5	36.97	2.7	478,948	20.56	2,865	1,569
中堅中小企業向けエクスポージャー													
1	0.00以上0.15未満	6,037	1,000	—	6,037	0.13	0.0	35.71	2.2	1,424	23.59	2	／
2	0.15以上0.25未満	12,645	290	—	12,645	0.18	0.0	11.29	4.1	1,121	8.87	2	／
3	0.25以上0.50未満	20,138	1,073	99.06	21,201	0.41	0.1	8.40	4.7	2,536	11.96	7	／
4	0.50以上0.75未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	／
5	0.75以上2.50未満	109,503	3,843	100.00	113,347	1.10	0.5	6.77	4.9	16,525	14.57	85	／
6	2.50以上10.00未満	45,644	—	—	45,486	2.70	0.1	6.39	4.9	7,687	16.90	78	／
7	10.00以上100.00未満	2,817	—	—	2,817	12.97	0.0	14.00	4.8	1,690	59.98	51	／
8	100.00(デフォルト)	508	—	—	508	100.00	0.0	46.09	4.7	78	15.36	228	／
9	小計	197,296	6,206	79.05	202,044	1.72	0.8	8.20	4.8	31,064	15.37	456	250
特定貸付債権													
1	0.00以上0.15未満	604,842	—	—	599,469	0.05	0.1	29.41	3.7	102,420	17.08	92	／
2	0.15以上0.25未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	／
3	0.25以上0.50未満	4,000	—	—	4,000	0.41	0.0	28.47	5.0	2,321	58.03	4	／
4	0.50以上0.75未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	／
5	0.75以上2.50未満	1,667	—	—	1,667	0.77	0.0	28.47	2.1	834	50.06	3	／
6	2.50以上10.00未満	1,924	—	—	1,924	2.70	0.0	37.03	5.0	2,471	128.42	19	／
7	10.00以上100.00未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	／
8	100.00(デフォルト)	596	—	—	596	100.00	0.0	83.14	—	42	7.12	496	／
9	小計	613,031	—	—	607,658	0.16	0.1	29.48	3.7	108,090	17.78	616	337
株式等エクスポージャー(PD/LGD方式が適用されるエクスポージャー)													
1	0.00以上0.15未満	155,530	—	—	155,530	0.05	0.2	90.00	5.0	157,034	100.96	／	／
2	0.15以上0.25未満	5,195	—	—	5,195	0.18	0.0	90.00	5.0	6,922	133.25	／	／
3	0.25以上0.50未満	2,493	—	—	2,493	0.41	0.0	90.00	5.0	4,811	192.98	／	／
4	0.50以上0.75未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	／	／
5	0.75以上2.50未満	4,245	—	—	4,245	1.19	0.0	90.00	5.0	11,464	270.05	／	／
6	2.50以上10.00未満	996	—	—	996	4.42	0.0	90.00	5.0	3,956	396.91	／	／
7	10.00以上100.00未満	584	—	—	584	12.97	0.0	90.00	5.0	3,655	625.51	／	／
8	100.00(デフォルト)	37	—	—	37	100.00	0.0	90.00	5.0	425	1,125.00	／	／
9	小計	169,082	—	—	169,082	0.18	0.4	90.00	5.0	188,270	111.34	／	／

(次ページへ続く)

みずほ信託銀行連結の自己資本の充実の状況

(続き)

(単位：百万円、%、千件、年)

項番	PD 区分	2023年度中間期											
		イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ	ト	チ	リ	ヌ	ル	ヲ
		オン・バランスシート・グロスエクスポージャーの額	CCF・信用リスク削減手法適用前のオフ・バランスシート・エクスポージャーの額	平均CCF	CCF・信用リスク削減手法適用後のEAD	平均PD	債務者の数	平均LGD	平均残存期間	信用リスク・アセットの額	リスクウェイトの加重平均値(RWA density)	EL	適格引当金
購入債権(事業法人等向け) -デフォルト・リスク相当分													
1	0.00以上0.15未満	23,815	—	—	23,618	0.03	0.0	37.03	0.0	832	3.52	3	—
2	0.15以上0.25未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
3	0.25以上0.50未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
4	0.50以上0.75未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
5	0.75以上2.50未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
6	2.50以上10.00未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
7	10.00以上100.00未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
8	100.00(デフォルト)	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
9	小計	23,815	—	—	23,618	0.03	0.0	37.03	0.0	832	3.52	3	1
購入債権(リテール向け) -デフォルト・リスク相当分													
1	0.00以上0.15未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
2	0.15以上0.25未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
3	0.25以上0.50未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
4	0.50以上0.75未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
5	0.75以上2.50未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
6	2.50以上10.00未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
7	10.00以上100.00未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
8	100.00(デフォルト)	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
9	小計	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
購入債権(希薄化リスク相当分)													
1	0.00以上0.15未満	19,849	—	—	19,849	0.03	0.0	31.74	—	1,441	7.26	2	—
2	0.15以上0.25未満	3,965	—	—	3,965	0.18	0.0	31.74	—	945	23.85	2	—
3	0.25以上0.50未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
4	0.50以上0.75未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
5	0.75以上2.50未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
6	2.50以上10.00未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
7	10.00以上100.00未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
8	100.00(デフォルト)	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
9	小計	23,815	—	—	23,815	0.06	0.0	31.74	—	2,387	10.02	5	—
適格リボルビング型リテール向けエクスポージャー													
1	0.00以上0.15未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
2	0.15以上0.25未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
3	0.25以上0.50未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
4	0.50以上0.75未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
5	0.75以上2.50未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
6	2.50以上10.00未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
7	10.00以上100.00未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
8	100.00(デフォルト)	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
9	小計	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
居住用不動産向けエクスポージャー													
1	0.00以上0.15未満	170	—	—	170	0.10	0.1	43.28	—	18	10.72	0	—
2	0.15以上0.25未満	471	—	—	471	0.21	0.2	43.28	—	84	17.95	0	—
3	0.25以上0.50未満	14,429	—	—	14,429	0.35	1.9	43.28	—	3,775	26.16	21	—
4	0.50以上0.75未満	7,604	—	—	7,604	0.65	0.9	43.28	—	3,077	40.47	21	—
5	0.75以上2.50未満	14,570	—	—	14,570	0.91	0.4	43.28	—	7,422	50.94	57	—
6	2.50以上10.00未満	961	—	—	961	6.84	0.1	43.28	—	1,574	163.64	28	—
7	10.00以上100.00未満	437	—	—	437	51.22	0.0	43.28	—	863	197.45	96	—
8	100.00(デフォルト)	468	—	—	468	100.00	0.0	45.88	—	324	69.12	189	—
9	小計	39,114	—	—	39,114	2.53	3.9	43.31	—	17,140	43.82	415	227
その他リテール向けエクスポージャー													
1	0.00以上0.15未満	18	—	—	18	0.09	0.0	50.08	—	2	11.00	0	—
2	0.15以上0.25未満	26	—	—	26	0.20	0.0	43.28	—	4	18.02	0	—
3	0.25以上0.50未満	93,138	—	—	93,138	0.30	2.5	49.79	—	24,997	26.83	143	—
4	0.50以上0.75未満	601	—	—	601	0.71	0.5	80.73	—	422	70.29	3	—
5	0.75以上2.50未満	979	—	—	979	1.67	0.2	43.28	—	520	53.16	7	—
6	2.50以上10.00未満	295	—	—	295	3.15	0.4	0.81	—	4	1.35	0	—
7	10.00以上100.00未満	373	—	—	373	22.86	0.0	60.70	—	510	136.78	51	—
8	100.00(デフォルト)	819	—	—	819	100.00	0.0	57.70	—	731	89.35	414	—
9	小計	96,252	—	—	96,252	1.26	3.9	49.88	—	27,193	28.25	620	339
合計(全てのポートフォリオ)		5,765,720	434,703	68.87	6,064,941	0.34	9.7	36.99	1.7	868,387	14.31	4,998	2,734

注) 1. カウンターパーティ信用リスク、証券化エクスポージャー、信用リスク・アセットのみならず計算が適用されるエクスポージャーを除いています。
 2. オン・バランスシート・グロスエクスポージャーの額、CCF・信用リスク削減手法適用前のオフ・バランスシート・エクスポージャーの額、平均CCFは信用リスク削減手法適用前のPD推計値に基づき、PD区分に割り当てています。
 3. 債務者の数は、適格リボルビング型リテール向けエクスポージャー、居住用不動産向けエクスポージャー、その他リテール向けエクスポージャー(事業性・信を除く)においては、債権の数を開示しています。

(B) CR10：内部格付手法－特定貸付債権(スロットティング・クライテリア方式)と株式等エクスポージャー(マーケット・ベース方式等)

(単位：百万円、%)

2022年度中間期											
イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ	ト	チ	リ	ヌ	ル	ヲ
特定貸付債権(スロットティング・クライテリア方式)											
ボラティリティの高い事業用不動産向け貸付け(HVCRE)以外											
規制上の区分	残存期間	オン・バ ランスシ ートの額	オフ・バ ランスシ ートの額	リスク ・ウェ イト	エクスポージャーの額(EAD)					信用リスク ・アセ ットの額	期待損失
					PF	OF	CF	IPRE	合計		
優(Strong)	2.5年未満	—	—	50%	—	—	—	—	—	—	—
	2.5年以上	—	—	70%	—	—	—	—	—	—	—
良(Good)	2.5年未満	—	—	70%	—	—	—	—	—	—	—
	2.5年以上	—	—	90%	—	—	—	—	—	—	—
可(Satisfactory)		—	—	115%	—	—	—	—	—	—	—
弱い(Weak)		—	—	250%	—	—	—	—	—	—	—
デフォルト(Default)		—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
合計		—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
ボラティリティの高い事業用不動産向け貸付け(HVCRE)											
規制上の区分	残存期間	オン・バ ランスシ ートの額	オフ・バ ランスシ ートの額	リスク ・ウェ イト		エクスポ ージャー の額 (EAD)	信用リスク ・アセ ットの額	期待損失			
優(Strong)	2.5年未満	—	—	70%		—	—	—			
	2.5年以上	—	—	95%		—	—	—			
良(Good)	2.5年未満	—	—	95%		—	—	—			
	2.5年以上	—	—	120%		—	—	—			
可(Satisfactory)		—	—	140%		—	—	—			
弱い(Weak)		—	—	250%		—	—	—			
デフォルト(Default)		—	—	—		—	—	—			
合計		—	—	—		—	—	—			
株式等エクスポージャー(マーケット・ベース方式等)											
マーケット・ベース方式が適用される株式等エクスポージャー											
カテゴリー	オン・バ ランスシ ートの額	オフ・バ ランスシ ートの額	リスク ・ウェ イト		エクスポ ージャー の額 (EAD)	信用リスク ・アセ ットの額	期待損失				
簡易手法－上場株式	7,072	—	300%		7,072	21,216					
簡易手法－非上場株式	29,793	—	400%		29,793	119,172					
内部モデル手法	—	—	—		—	—					
合計	36,865	—	—		36,865	140,389					
100%のリスク・ウェイトが適用される株式等エクスポージャー											
自己資本比率告示第166条第1項ただし書又は持株自己資本比率告示第144条第1項ただし書の定めるところにより100%のリスク・ウェイトが適用される株式等エクスポージャー	—	—	100%		—	—					

注) 1. カウンターパーティ信用リスク、証券化エクスポージャー、信用リスク・アセットのみなし計算が適用されるエクスポージャーを除いています。
2. PF、OF、CF、IPREは、それぞれプロジェクト・ファイナンス、オブジェクト・ファイナンス、コモディティ・ファイナンス、事業用不動産向け貸付けの略称です。

みずほ信託銀行連結の自己資本の充実の状況

(単位：百万円、%)

2023年度中間期											
イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ	ト	チ	リ	ヌ	ル	ヲ
特定貸付債権(スロッシング・クライテリア方式)											
ボラティリティの高い事業用不動産向け貸付け(HVCRE)以外											
規制上の区分	残存期間	オン・パ ランスシ ートの額	オフ・パ ランスシ ートの額	リスク ・ウエ イト	エクスポージャーの額(EAD)					信用リスク ・アセ ットの額	期待損失
					PF	OF	CF	IPRE	合計		
優(Strong)	2.5年未満	—	—	50%	—	—	—	—	—	—	—
	2.5年以上	—	—	70%	—	—	—	—	—	—	—
良(Good)	2.5年未満	—	—	70%	—	—	—	—	—	—	—
	2.5年以上	—	—	90%	—	—	—	—	—	—	—
可(Satisfactory)		—	—	115%	—	—	—	—	—	—	—
弱い(Weak)		—	—	250%	—	—	—	—	—	—	—
デフォルト(Default)		—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
合計		—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
ボラティリティの高い事業用不動産向け貸付け(HVCRE)											
規制上の区分	残存期間	オン・パ ランスシ ートの額	オフ・パ ランスシ ートの額	リスク ・ウエ イト		エクスポ ージャー の額 (EAD)	信用リスク ・アセ ットの額	期待損失			
優(Strong)	2.5年未満	—	—	70%		—	—	—			
	2.5年以上	—	—	95%		—	—	—			
良(Good)	2.5年未満	—	—	95%		—	—	—			
	2.5年以上	—	—	120%		—	—	—			
可(Satisfactory)		—	—	140%		—	—	—			
弱い(Weak)		—	—	250%		—	—	—			
デフォルト(Default)		—	—	—		—	—	—			
合計		—	—	—		—	—	—			
株式等エクスポージャー(マーケット・ベース方式等)											
マーケット・ベース方式が適用される株式等エクスポージャー											
カテゴリー		オン・パ ランスシ ートの額	オフ・パ ランスシ ートの額	リスク ・ウエ イト		エクスポ ージャー の額 (EAD)	信用リスク ・アセ ットの額	期待損失			
簡易手法ー上場株式		6,959	—	300%		6,959	20,878				
簡易手法ー非上場株式		29,515	—	400%		29,515	118,063				
内部モデル手法		—	—	—		—	—				
合計		36,475	—	—		36,475	138,942				
100%のリスク・ウエイトが適用される株式等エクスポージャー											
自己資本比率告示第166条第1項ただし書又は持株自己資本比率告示第144条第1項ただし書の定めるところにより100%のリスク・ウエイトが適用される株式等エクスポージャー		—	—	100%		—	—				

注) 1. カウンターパーティ信用リスク、証券化エクスポージャー、信用リスク・アセットのみなし計算が適用されるエクスポージャーを除いています。
 2. PF、OF、CF、IPREは、それぞれプロジェクト・ファイナンス、オブジェクト・ファイナンス、コモディティ・ファイナンス、事業用不動産向け貸付けの略称です。

(3) 標準的手法における信用リスク

(i) 標準的手法に関する定量的開示事項

(A) CR5：標準的手法－資産クラス及びリスク・ウェイト別の信用リスク・エクスポージャー

(単位：百万円)

		2022年度中間期											
		イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ	ト	チ	リ	ヌ	ル	
		信用リスク・エクスポージャーの額(CCF・信用リスク削減手法適用後)											
項番	資産クラス	リスク・ウェイト	0%	10%	20%	35%	50%	75%	100%	150%	250%	1250%	合計
1	現金		0	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0
2	日本国政府及び日本銀行向け		11,704	-	-	-	-	-	-	-	-	-	11,704
3	外国の中央政府及び中央銀行向け		46,587	-	-	-	-	-	-	-	-	-	46,587
4	国際決済銀行等向け		-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
5	我が国の地方公共団体向け		-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
6	外国の中央政府等以外の公共部門向け		-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
7	国際開発銀行向け		-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
8	地方公共団体金融機構向け		-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
9	我が国の政府関係機関向け		-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
10	地方三公社向け		-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
11	金融機関及び第一種金融商品取引業者向け		-	-	102,080	-	756	-	3,455	-	-	-	106,292
12	法人等向け		-	-	-	-	-	-	1,053	-	-	-	1,053
13	中小企業等向け及び個人向け		-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
14	抵当権付住宅ローン		-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
15	不動産取得等事業向け		-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
16	三月以上延滞等(抵当権付住宅ローンを除く。)		-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
17	抵当権付住宅ローンに係る三月以上延滞		-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
18	取立未済手形		-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
19	信用保証協会等による保証付		-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
20	株式会社地域経済活性化支援機構等による保証付		-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
21	出資等(重要な出資を除く。)		-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
22	合計		58,292	-	102,080	-	756	-	4,508	-	-	-	165,638

注) カウンターパーティ信用リスク、証券化取引に係る信用リスク及びリスク・ウェイトのみなし計算に係る信用リスクを除いています。

(単位：百万円)

		2023年度中間期											
		イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ	ト	チ	リ	ヌ	ル	
		信用リスク・エクスポージャーの額(CCF・信用リスク削減手法適用後)											
項番	資産クラス	リスク・ウェイト	0%	10%	20%	35%	50%	75%	100%	150%	250%	1250%	合計
1	現金		0	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0
2	日本国政府及び日本銀行向け		11,605	-	-	-	-	-	-	-	-	-	11,605
3	外国の中央政府及び中央銀行向け		45,861	-	-	-	-	-	-	-	-	-	45,861
4	国際決済銀行等向け		-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
5	我が国の地方公共団体向け		-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
6	外国の中央政府等以外の公共部門向け		-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
7	国際開発銀行向け		-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
8	地方公共団体金融機構向け		-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
9	我が国の政府関係機関向け		-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
10	地方三公社向け		-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
11	金融機関及び第一種金融商品取引業者向け		-	-	95,364	-	340	-	236	-	-	-	95,940
12	法人等向け		-	-	-	-	-	-	1,226	-	-	-	1,226
13	中小企業等向け及び個人向け		-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
14	抵当権付住宅ローン		-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
15	不動産取得等事業向け		-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
16	三月以上延滞等(抵当権付住宅ローンを除く。)		-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
17	抵当権付住宅ローンに係る三月以上延滞		-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
18	取立未済手形		-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
19	信用保証協会等による保証付		-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
20	株式会社地域経済活性化支援機構等による保証付		-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
21	出資等(重要な出資を除く。)		-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
22	合計		57,468	-	95,364	-	340	-	1,462	-	-	-	154,635

注) カウンターパーティ信用リスク、証券化取引に係る信用リスク及びリスク・ウェイトのみなし計算に係る信用リスクを除いています。

みずほ信託銀行連結の自己資本の充実の状況

(4) 信用リスク削減手法

(i) 信用リスク削減手法に関する定量的開示事項

カウンターパーティ信用リスク、証券化エクスポージャー、信用リスク・アセットのみなし計算が適用されるエクスポージャーを除いています。

(A) CR3：信用リスク削減手法

(単位：百万円)

項番		2022年度中間期				
		イ	ロ	ハ	ニ	ホ
		非保全 エクスポージャー	保全された エクスポージャー	担保で保全された エクスポージャー	保証で保全された エクスポージャー	クレジット・デリバ ティブで保全された エクスポージャー
1	貸出金	2,259,860	869,273	691,759	20,368	—
2	有価証券(負債性のもの)	33,198	90,656	69,418	—	—
3	その他オン・バランスシートの資産 (負債性のもの)	2,399,050	—	—	—	—
4	合計 (1+2+3)	4,692,109	959,930	761,177	20,368	—
5	うちデフォルトしたもの	2,263	8,085	1,212	6,088	—

注) 1. その他オン・バランスシートの資産(うち負債性のもの)には預け金、コールローン、買入手形、買入金銭債権、金銭の信託、外国為替等が含まれます。
2. うちデフォルトしたものには貸出条件緩和債権、3か月以上延滞債権、破綻先債権等が含まれています。

(単位：百万円)

項番		2023年度中間期				
		イ	ロ	ハ	ニ	ホ
		非保全 エクスポージャー	保全された エクスポージャー	担保で保全された エクスポージャー	保証で保全された エクスポージャー	クレジット・デリバ ティブで保全された エクスポージャー
1	貸出金	2,156,683	775,371	624,174	17,798	—
2	有価証券(負債性のもの)	36,623	65,826	50,566	—	—
3	その他オン・バランスシートの資産 (負債性のもの)	2,638,808	—	—	—	—
4	合計 (1+2+3)	4,832,116	841,197	674,741	17,798	—
5	うちデフォルトしたもの	6,050	10,519	4,549	5,372	—

注) 1. その他オン・バランスシートの資産(うち負債性のもの)には預け金、コールローン、買入手形、買入金銭債権、金銭の信託、外国為替等が含まれます。
2. うちデフォルトしたものには貸出条件緩和債権、3か月以上延滞債権、破綻先債権等が含まれています。

(B) CR4：標準的手法－信用リスク・エクスポージャーと信用リスク削減手法の効果

(単位：百万円、%)

項番	資産クラス	2022年度中間期											
		イ		ロ		ハ		ニ		ホ		ヘ	
		CCF・信用リスク削減手法 適用前のエクスポージャー		CCF・信用リスク削減手法 適用後のエクスポージャー		信用リスク・ アセットの額		リスク・ウェイト の加重平均値 (RWA density)					
		オン・バランス シートの額	オフ・バランス シートの額	オン・バランス シートの額	オフ・バランス シートの額	オン・バランス シートの額	オフ・バランス シートの額	オン・バランス シートの額	オフ・バランス シートの額	オン・バランス シートの額	オフ・バランス シートの額	オン・バランス シートの額	オフ・バランス シートの額
1	現金	0	—	0	—	—	—	—	—	—	—	0.00	
2	日本国政府及び日本銀行向け	11,704	—	11,704	—	—	—	—	—	—	—	0.00	
3	外国の中央政府及び中央銀行向け	46,587	—	46,587	—	—	—	—	—	—	—	0.00	
4	国際決済銀行等向け	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
5	我が国の地方公共団体向け	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
6	外国の中央政府等以外の公共部門向け	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
7	国際開発銀行向け	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
8	地方公共団体金融機構向け	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
9	我が国の政府関係機関向け	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
10	地方三公社向け	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
11	金融機関及び第一種金融商品取引業者向け	106,292	—	106,292	—	24,249	—	22.81	—	—	—	—	
12	法人等向け	1,053	—	1,053	—	1,053	—	100.00	—	—	—	—	
13	中小企業等向け及び個人向け	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
14	抵当権付住宅ローン	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
15	不動産取得等事業向け	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
16	三月以上延滞等(抵当権付住宅ローンを除く。)	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
17	抵当権付住宅ローンに係る三月以上延滞	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
18	取立未済手形	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
19	信用保証協会等による保証付	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
20	株式会社地域経済活性化支援機構等による保証付	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
21	出資等(重要な出資を除く。)	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
22	合計	165,638	—	165,638	—	25,303	—	15.27	—	—	—	—	

(単位：百万円、%)

項番	資産クラス	2023年度中間期											
		イ		ロ		ハ		ニ		ホ		ヘ	
		CCF・信用リスク削減手法 適用前のエクスポージャー		CCF・信用リスク削減手法 適用後のエクスポージャー		信用リスク・ アセットの額		リスク・ウェイト の加重平均値 (RWA density)					
		オン・バランス シートの額	オフ・バランス シートの額	オン・バランス シートの額	オフ・バランス シートの額	オン・バランス シートの額	オフ・バランス シートの額	オン・バランス シートの額	オフ・バランス シートの額	オン・バランス シートの額	オフ・バランス シートの額	オン・バランス シートの額	オフ・バランス シートの額
1	現金	0	—	0	—	—	—	—	—	—	—	0.00	
2	日本国政府及び日本銀行向け	11,605	—	11,605	—	—	—	—	—	—	—	0.00	
3	外国の中央政府及び中央銀行向け	45,861	—	45,861	—	—	—	—	—	—	—	0.00	
4	国際決済銀行等向け	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
5	我が国の地方公共団体向け	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
6	外国の中央政府等以外の公共部門向け	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
7	国際開発銀行向け	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
8	地方公共団体金融機構向け	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
9	我が国の政府関係機関向け	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
10	地方三公社向け	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
11	金融機関及び第一種金融商品取引業者向け	95,940	—	95,940	—	19,479	—	20.30	—	—	—	—	
12	法人等向け	1,226	—	1,226	—	1,226	—	100.00	—	—	—	—	
13	中小企業等向け及び個人向け	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
14	抵当権付住宅ローン	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
15	不動産取得等事業向け	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
16	三月以上延滞等(抵当権付住宅ローンを除く。)	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
17	抵当権付住宅ローンに係る三月以上延滞	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
18	取立未済手形	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
19	信用保証協会等による保証付	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
20	株式会社地域経済活性化支援機構等による保証付	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
21	出資等(重要な出資を除く。)	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
22	合計	154,635	—	154,635	—	20,705	—	13.38	—	—	—	—	

みずほ信託銀行

● 連結の自己資本の充実の状況

みずほ信託銀行連結の自己資本の充実の状況

(C) CR7：内部格付手法－信用リスク削減手法として用いられるクレジット・デリバティブが信用リスク・アセットの額に与える影響 (単位：百万円)

項番	ポートフォリオ	2022年度中間期	
		イ	ロ
		クレジット・デリバティブ 勘案前の信用リスク・ アセットの額	実際の信用リスク・ アセットの額
1	ソブリン向けエクスポージャー -FIRB	—	—
2	ソブリン向けエクスポージャー -AIRB	851	851
3	金融機関等向けエクスポージャー -FIRB	—	—
4	金融機関等向けエクスポージャー -AIRB	18,669	18,669
5	事業法人向けエクスポージャー(特定貸付債権を除く。) -FIRB	—	—
6	事業法人向けエクスポージャー(特定貸付債権を除く。) -AIRB	534,220	534,220
7	特定貸付債権 -FIRB	—	—
8	特定貸付債権 -AIRB	157,784	157,784
9	リテール -適格リボルビング型リテール向けエクスポージャー	—	—
10	リテール -居住用不動産向けエクスポージャー	19,342	19,342
11	リテール -その他リテール向けエクスポージャー	29,593	29,593
12	株式 -FIRB	—	—
13	株式 -AIRB	173,448	173,448
14	購入債権 -FIRB	—	—
15	購入債権 -AIRB	3,771	3,771
16	合計	937,683	937,683

(単位：百万円)

項番	ポートフォリオ	2023年度中間期	
		イ	ロ
		クレジット・デリバティブ 勘案前の信用リスク・ アセットの額	実際の信用リスク・ アセットの額
1	ソブリン向けエクスポージャー -FIRB	—	—
2	ソブリン向けエクスポージャー -AIRB	1,584	1,584
3	金融機関等向けエクスポージャー -FIRB	—	—
4	金融機関等向けエクスポージャー -AIRB	12,873	12,873
5	事業法人向けエクスポージャー(特定貸付債権を除く。) -FIRB	—	—
6	事業法人向けエクスポージャー(特定貸付債権を除く。) -AIRB	510,013	510,013
7	特定貸付債権 -FIRB	—	—
8	特定貸付債権 -AIRB	108,090	108,090
9	リテール -適格リボルビング型リテール向けエクスポージャー	—	—
10	リテール -居住用不動産向けエクスポージャー	17,140	17,140
11	リテール -その他リテール向けエクスポージャー	27,193	27,193
12	株式 -FIRB	—	—
13	株式 -AIRB	188,270	188,270
14	購入債権 -FIRB	—	—
15	購入債権 -AIRB	3,220	3,220
16	合計	868,387	868,387

(5) 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が適用されるエクスポージャーの額

(単位：百万円)

	2022年度中間期	2023年度中間期
	期末残高	期末残高
ルック・スルー方式	36,404	52,699
マンドート方式	—	—
蓋然性方式250%	—	—
蓋然性方式400%	752	753
フォールバック方式1250%	197	238
合計	37,354	53,692

- 注) 1. ルック・スルー方式は、自己資本比率告示第76条の5第2項の規定により算出した割合をリスク・ウェイトとして用いるエクスポージャー又は同第167条第2項の規定により信用リスク・アセットの額を算出するエクスポージャーです。
2. マンドート方式は、自己資本比率告示第76条の5第6項の規定により算出した割合をリスク・ウェイトとして用いるエクスポージャー又は同第167条第7項の規定により信用リスク・アセットの額を算出するエクスポージャーです。
3. 蓋然性方式250%は、自己資本比率告示第76条の5第9項第1号に定める比率をリスク・ウェイトとして用いるエクスポージャー又は同第167条第10項第1号に定めるリスク・ウェイトを用いて信用リスク・アセットの額を算出するエクスポージャーです。
4. 蓋然性方式400%は、自己資本比率告示第76条の5第9項第2号に定める比率をリスク・ウェイトとして用いるエクスポージャー又は同第167条第10項第2号に定めるリスク・ウェイトを用いて信用リスク・アセットの額を算出するエクスポージャーです。
5. フォールバック方式1250%は、自己資本比率告示第76条の5第10項のリスク・ウェイトを用いるエクスポージャー又は同第167条第11項の規定により信用リスク・アセットの額を算出するエクスポージャーの額です。

みずほ信託銀行連結の自己資本の充実の状況

■カウンターパーティ信用リスク

(1) カウンターパーティ信用リスクに関する定量的開示事項

(A) CCR1：手法別のカウンターパーティ信用リスク・エクスポージャー額

(単位：百万円)

項番		2022年度中間期					
		イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ
		RC	PFE	実効EPE	規制上のエクスポージャーの算定に使用される α	信用リスク削減手法適用後のエクスポージャー	リスク・アセットの額
1	SA-CCR カレント・エクスポージャー方式	—	—	/	1.4	—	—
2	期待エクスポージャー方式	/	/	—	1.4	—	—
3	信用リスク削減手法における簡便手法	/	/	/	/	191	—
4	信用リスク削減手法における包括的手法	/	/	/	/	105,101	4
5	エクスポージャー変動推計モデル	/	/	/	/	—	—
6	合計	/	/	/	/	/	4

(単位：百万円)

項番		2023年度中間期					
		イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ
		RC	PFE	実効EPE	規制上のエクスポージャーの算定に使用される α	信用リスク削減手法適用後のエクスポージャー	リスク・アセットの額
1	SA-CCR カレント・エクスポージャー方式	—	—	/	1.4	—	—
2	期待エクスポージャー方式	/	/	—	1.4	—	—
3	信用リスク削減手法における簡便手法	/	/	/	/	—	—
4	信用リスク削減手法における包括的手法	/	/	/	/	59,647	17
5	エクスポージャー変動推計モデル	/	/	/	/	—	—
6	合計	/	/	/	/	/	17

(B) CCR2：CVAリスクに対する資本賦課

(単位：百万円)

項番		2022年度中間期	
		イ	ロ
		信用リスク削減手法適用後のエクスポージャー	リスク・アセットの額(CVAリスク相当額を8%で除して得た額)
1	先進的リスク測定方式の対象となるポートフォリオの合計	—	—
2	(i) CVAバリュー・アット・リスクの額(乗数適用後)	/	—
3	(ii) CVAストレス・バリュー・アット・リスクの額(乗数適用後)	/	—
4	標準的リスク測定方式の対象となるポートフォリオの合計	—	—
5	CVAリスク相当額の対象となるポートフォリオの合計	—	—

(単位：百万円)

項番		2023年度中間期	
		イ	ロ
		信用リスク削減手法適用後のエクスポージャー	リスク・アセットの額(CVAリスク相当額を8%で除して得た額)
1	先進的リスク測定方式の対象となるポートフォリオの合計	—	—
2	(i) CVAバリュー・アット・リスクの額(乗数適用後)	/	—
3	(ii) CVAストレス・バリュー・アット・リスクの額(乗数適用後)	/	—
4	標準的リスク測定方式の対象となるポートフォリオの合計	—	—
5	CVAリスク相当額の対象となるポートフォリオの合計	—	—

(C) CCR3：業種別及びリスク・ウェイト別のカウンターパーティ信用リスク・エクスポージャー

(単位：百万円)

リスク・ウェイト		2022年度中間期								
		イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ	ト	チ	リ
		与信相当額(信用リスク削減効果勘案後)								
項番	業種	0%	10%	20%	50%	75%	100%	150%	その他	合計
1	日本国政府及び日本銀行向け	191	—	—	—	—	—	—	—	191
2	外国の中央政府及び中央銀行向け	—	—	—	—	—	—	—	—	—
3	国際決済銀行等向け	—	—	—	—	—	—	—	—	—
4	我が国の地方公共団体向け	—	—	—	—	—	—	—	—	—
5	外国の中央政府等以外の公共部門向け	—	—	—	—	—	—	—	—	—
6	国際開発銀行向け	—	—	—	—	—	—	—	—	—
7	地方公共団体金融機構向け	—	—	—	—	—	—	—	—	—
8	我が国の政府関係機関向け	—	—	—	—	—	—	—	—	—
9	地方三公社向け	—	—	—	—	—	—	—	—	—
10	金融機関及び第一種金融商品取引業者向け	—	—	—	—	—	—	—	—	—
11	法人等向け	—	—	—	—	—	—	—	—	—
12	中小企業等向け及び個人向け	—	—	—	—	—	—	—	—	—
13	上記以外	—	—	—	—	—	—	—	—	—
14	合計	191	—	—	—	—	—	—	—	191

(単位：百万円)

リスク・ウェイト		2023年度中間期								
		イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ	ト	チ	リ
		与信相当額(信用リスク削減効果勘案後)								
項番	業種	0%	10%	20%	50%	75%	100%	150%	その他	合計
1	日本国政府及び日本銀行向け	—	—	—	—	—	—	—	—	—
2	外国の中央政府及び中央銀行向け	—	—	—	—	—	—	—	—	—
3	国際決済銀行等向け	—	—	—	—	—	—	—	—	—
4	我が国の地方公共団体向け	—	—	—	—	—	—	—	—	—
5	外国の中央政府等以外の公共部門向け	—	—	—	—	—	—	—	—	—
6	国際開発銀行向け	—	—	—	—	—	—	—	—	—
7	地方公共団体金融機構向け	—	—	—	—	—	—	—	—	—
8	我が国の政府関係機関向け	—	—	—	—	—	—	—	—	—
9	地方三公社向け	—	—	—	—	—	—	—	—	—
10	金融機関及び第一種金融商品取引業者向け	—	—	—	—	—	—	—	—	—
11	法人等向け	—	—	—	—	—	—	—	—	—
12	中小企業等向け及び個人向け	—	—	—	—	—	—	—	—	—
13	上記以外	—	—	—	—	—	—	—	—	—
14	合計	—	—	—	—	—	—	—	—	—

みずほ信託銀行連結の自己資本の充実の状況

(D) CCR4：内部格付手法—ポートフォリオ別及びPD区分別のカウンターパーティ信用リスク・エクスポージャー
(単位：百万円、%、千件、年)

項番	PD区分	2022年度中間期						
		イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ	ト
		EAD(信用リスク削減効果勘案後)	平均PD	取引相手方の数	平均LGD	平均残存期間	信用リスク・アセット	リスク・ウェイトの加重平均値(RWA density)
ソブリン向けエクスポージャー								
1	0.00 以上0.15 未満	105,018	0.00	0.0	37.61	1.0	0	0.00
2	0.15 以上0.25 未満	—	—	—	—	—	—	—
3	0.25 以上0.50 未満	—	—	—	—	—	—	—
4	0.50 以上0.75 未満	—	—	—	—	—	—	—
5	0.75 以上2.50 未満	—	—	—	—	—	—	—
6	2.50 以上10.00 未満	—	—	—	—	—	—	—
7	10.00 以上100.00 未満	—	—	—	—	—	—	—
8	100.00(デフォルト)	—	—	—	—	—	—	—
9	小計	105,018	0.00	0.0	37.61	1.0	0	0.00
金融機関等向けエクスポージャー								
1	0.00 以上0.15 未満	83	0.03	0.0	37.61	0.2	4	4.91
2	0.15 以上0.25 未満	—	—	—	—	—	—	—
3	0.25 以上0.50 未満	—	—	—	—	—	—	—
4	0.50 以上0.75 未満	—	—	—	—	—	—	—
5	0.75 以上2.50 未満	—	—	—	—	—	—	—
6	2.50 以上10.00 未満	—	—	—	—	—	—	—
7	10.00 以上100.00 未満	—	—	—	—	—	—	—
8	100.00(デフォルト)	—	—	—	—	—	—	—
9	小計	83	0.03	0.0	37.61	0.2	4	4.91
事業法人向けエクスポージャー(中堅中小企業向けエクスポージャー及び特定貸付債権を除く。)								
1	0.00 以上0.15 未満	—	—	—	—	—	—	—
2	0.15 以上0.25 未満	—	—	—	—	—	—	—
3	0.25 以上0.50 未満	—	—	—	—	—	—	—
4	0.50 以上0.75 未満	—	—	—	—	—	—	—
5	0.75 以上2.50 未満	—	—	—	—	—	—	—
6	2.50 以上10.00 未満	—	—	—	—	—	—	—
7	10.00 以上100.00 未満	—	—	—	—	—	—	—
8	100.00(デフォルト)	—	—	—	—	—	—	—
9	小計	—	—	—	—	—	—	—
中堅中小企業向けエクスポージャー								
1	0.00 以上0.15 未満	—	—	—	—	—	—	—
2	0.15 以上0.25 未満	—	—	—	—	—	—	—
3	0.25 以上0.50 未満	—	—	—	—	—	—	—
4	0.50 以上0.75 未満	—	—	—	—	—	—	—
5	0.75 以上2.50 未満	—	—	—	—	—	—	—
6	2.50 以上10.00 未満	—	—	—	—	—	—	—
7	10.00 以上100.00 未満	—	—	—	—	—	—	—
8	100.00(デフォルト)	—	—	—	—	—	—	—
9	小計	—	—	—	—	—	—	—
特定貸付債権								
1	0.00 以上0.15 未満	—	—	—	—	—	—	—
2	0.15 以上0.25 未満	—	—	—	—	—	—	—
3	0.25 以上0.50 未満	—	—	—	—	—	—	—
4	0.50 以上0.75 未満	—	—	—	—	—	—	—
5	0.75 以上2.50 未満	—	—	—	—	—	—	—
6	2.50 以上10.00 未満	—	—	—	—	—	—	—
7	10.00 以上100.00 未満	—	—	—	—	—	—	—
8	100.00(デフォルト)	—	—	—	—	—	—	—
9	小計	—	—	—	—	—	—	—

(次ページへ続く)

(続き)

(単位：百万円、%、千件、年)

		2022年度中間期						
		イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ	ト
項番	PD区分	EAD(信用リスク削減効果勘案後)	平均PD	取引相手方の数	平均LGD	平均残存期間	信用リスク・アセットリスク・ウェイトの加重平均値(RWA density)	
購入債権								
1	0.00 以上0.15 未満	—	—	—	—	—	—	—
2	0.15 以上0.25 未満	—	—	—	—	—	—	—
3	0.25 以上0.50 未満	—	—	—	—	—	—	—
4	0.50 以上0.75 未満	—	—	—	—	—	—	—
5	0.75 以上2.50 未満	—	—	—	—	—	—	—
6	2.50 以上10.00 未満	—	—	—	—	—	—	—
7	10.00 以上100.00 未満	—	—	—	—	—	—	—
8	100.00(デフォルト)	—	—	—	—	—	—	—
9	小計	—	—	—	—	—	—	—
リテール向けエクスポージャー								
1	0.00 以上0.15 未満	—	—	—	—	/	—	—
2	0.15 以上0.25 未満	—	—	—	—	/	—	—
3	0.25 以上0.50 未満	—	—	—	—	/	—	—
4	0.50 以上0.75 未満	—	—	—	—	/	—	—
5	0.75 以上2.50 未満	—	—	—	—	/	—	—
6	2.50 以上10.00 未満	—	—	—	—	/	—	—
7	10.00 以上100.00 未満	—	—	—	—	/	—	—
8	100.00(デフォルト)	—	—	—	—	/	—	—
9	小計	—	—	—	—	/	—	—
合計(全てのポートフォリオ)		105,101	0.00	0.0	37.61	0.9	4	0.00

みずほ信託銀行連結の自己資本の充実の状況

(単位：百万円、%、千件、年)

項番	PD区分	2023年度中間期						
		イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ	ト
		EAD(信用リスク削減効果勘案後)	平均PD	取引相手方の数	平均LGD	平均残存期間	信用リスク・アセット	リスク・ウェイトの加重平均値(RWA density)
ソブリン向けエクスポージャー								
1	0.00 以上0.15 未満	59,301	0.00	0.0	37.03	1.0	0	0.00
2	0.15 以上0.25 未満	—	—	—	—	—	—	—
3	0.25 以上0.50 未満	—	—	—	—	—	—	—
4	0.50 以上0.75 未満	—	—	—	—	—	—	—
5	0.75 以上2.50 未満	—	—	—	—	—	—	—
6	2.50 以上10.00 未満	—	—	—	—	—	—	—
7	10.00 以上100.00 未満	—	—	—	—	—	—	—
8	100.00(デフォルト)	—	—	—	—	—	—	—
9	小計	59,301	0.00	0.0	37.03	1.0	0	0.00
金融機関等向けエクスポージャー								
1	0.00 以上0.15 未満	345	0.03	0.0	37.03	0.3	17	4.95
2	0.15 以上0.25 未満	—	—	—	—	—	—	—
3	0.25 以上0.50 未満	—	—	—	—	—	—	—
4	0.50 以上0.75 未満	—	—	—	—	—	—	—
5	0.75 以上2.50 未満	—	—	—	—	—	—	—
6	2.50 以上10.00 未満	—	—	—	—	—	—	—
7	10.00 以上100.00 未満	—	—	—	—	—	—	—
8	100.00(デフォルト)	—	—	—	—	—	—	—
9	小計	345	0.03	0.0	37.03	0.3	17	4.95
事業法人向けエクスポージャー(中堅中小企業向けエクスポージャー及び特定貸付債権を除く。)								
1	0.00 以上0.15 未満	—	—	—	—	—	—	—
2	0.15 以上0.25 未満	—	—	—	—	—	—	—
3	0.25 以上0.50 未満	—	—	—	—	—	—	—
4	0.50 以上0.75 未満	—	—	—	—	—	—	—
5	0.75 以上2.50 未満	—	—	—	—	—	—	—
6	2.50 以上10.00 未満	—	—	—	—	—	—	—
7	10.00 以上100.00 未満	—	—	—	—	—	—	—
8	100.00(デフォルト)	—	—	—	—	—	—	—
9	小計	—	—	—	—	—	—	—
中堅中小企業向けエクスポージャー								
1	0.00 以上0.15 未満	—	—	—	—	—	—	—
2	0.15 以上0.25 未満	—	—	—	—	—	—	—
3	0.25 以上0.50 未満	—	—	—	—	—	—	—
4	0.50 以上0.75 未満	—	—	—	—	—	—	—
5	0.75 以上2.50 未満	—	—	—	—	—	—	—
6	2.50 以上10.00 未満	—	—	—	—	—	—	—
7	10.00 以上100.00 未満	—	—	—	—	—	—	—
8	100.00(デフォルト)	—	—	—	—	—	—	—
9	小計	—	—	—	—	—	—	—
特定貸付債権								
1	0.00 以上0.15 未満	—	—	—	—	—	—	—
2	0.15 以上0.25 未満	—	—	—	—	—	—	—
3	0.25 以上0.50 未満	—	—	—	—	—	—	—
4	0.50 以上0.75 未満	—	—	—	—	—	—	—
5	0.75 以上2.50 未満	—	—	—	—	—	—	—
6	2.50 以上10.00 未満	—	—	—	—	—	—	—
7	10.00 以上100.00 未満	—	—	—	—	—	—	—
8	100.00(デフォルト)	—	—	—	—	—	—	—
9	小計	—	—	—	—	—	—	—

(次ページへ続く)

(続き)

(単位：百万円、%、千件、年)

		2023年度中間期						
		イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ	ト
項番	PD区分	EAD(信用リスク削減効果勘案後)	平均PD	取引相手方の数	平均LGD	平均残存期間	信用リスク・アセットリスク・ウェイトの加重平均値(RWA density)	
購入債権								
1	0.00 以上0.15 未満	—	—	—	—	—	—	—
2	0.15 以上0.25 未満	—	—	—	—	—	—	—
3	0.25 以上0.50 未満	—	—	—	—	—	—	—
4	0.50 以上0.75 未満	—	—	—	—	—	—	—
5	0.75 以上2.50 未満	—	—	—	—	—	—	—
6	2.50 以上10.00 未満	—	—	—	—	—	—	—
7	10.00 以上100.00 未満	—	—	—	—	—	—	—
8	100.00(デフォルト)	—	—	—	—	—	—	—
9	小計	—	—	—	—	—	—	—
リテール向けエクスポージャー								
1	0.00 以上0.15 未満	—	—	—	—	/	—	—
2	0.15 以上0.25 未満	—	—	—	—	/	—	—
3	0.25 以上0.50 未満	—	—	—	—	/	—	—
4	0.50 以上0.75 未満	—	—	—	—	/	—	—
5	0.75 以上2.50 未満	—	—	—	—	/	—	—
6	2.50 以上10.00 未満	—	—	—	—	/	—	—
7	10.00 以上100.00 未満	—	—	—	—	/	—	—
8	100.00(デフォルト)	—	—	—	—	/	—	—
9	小計	—	—	—	—	/	—	—
合計(全てのポートフォリオ)		59,647	0.00	0.0	37.03	0.9	17	0.02

みずほ信託銀行連結の自己資本の充実の状況

(E) CCR5：担保の内訳

(単位：百万円)

項番	2022年度中間期					
	イ				ロ	
	派生商品取引で使用される担保				レボ形式の取引で使用される担保	
	受入担保の公正価値		差入担保の公正価値		受入担保の公正価値	差入担保の公正価値
分別管理されている	分別管理されていない	分別管理されている	分別管理されていない			
1	現金(国内通貨)	—	14,153	15,000	—	—
2	現金(外国通貨)	—	—	—	—	—
3	国内ソブリン債	—	—	—	19,955	—
4	その他ソブリン債	—	—	—	—	—
5	政府関係機関債	—	—	—	—	—
6	社債	—	—	—	—	—
7	株式	—	—	—	—	—
8	その他担保	—	—	—	—	105,018
9	合計	—	14,153	15,000	19,955	105,018

(単位：百万円)

項番	2023年度中間期					
	イ				ロ	
	派生商品取引で使用される担保				レボ形式の取引で使用される担保	
	受入担保の公正価値		差入担保の公正価値		受入担保の公正価値	差入担保の公正価値
分別管理されている	分別管理されていない	分別管理されている	分別管理されていない			
1	現金(国内通貨)	—	21,164	16,500	—	—
2	現金(外国通貨)	—	—	—	—	—
3	国内ソブリン債	—	—	—	39,972	—
4	その他ソブリン債	—	—	—	—	—
5	政府関係機関債	—	—	—	—	—
6	社債	—	—	—	—	—
7	株式	—	—	—	—	—
8	その他担保	—	—	—	—	59,301
9	合計	—	21,164	16,500	39,972	59,301

(F) CCR6：クレジット・デリバティブ取引のエクスポージャー

(単位：百万円)

項番		2022年度中間期	
		イ	ロ
		購入したプロテクション	提供したプロテクション
想定元本			
1	シングルネーム・クレジット・デフォルト・スワップ	—	—
2	インデックス・クレジット・デフォルト・スワップ	—	—
3	トータル・リターン・スワップ	—	—
4	クレジットオプション	—	—
5	その他のクレジット・デリバティブ	—	—
6	想定元本合計	—	—
公正価値			
7	プラスの公正価値(資産)	—	—
8	マイナスの公正価値(負債)	—	—

(単位：百万円)

項番		2023年度中間期	
		イ	ロ
		購入したプロテクション	提供したプロテクション
想定元本			
1	シングルネーム・クレジット・デフォルト・スワップ	—	—
2	インデックス・クレジット・デフォルト・スワップ	—	—
3	トータル・リターン・スワップ	—	—
4	クレジットオプション	—	—
5	その他のクレジット・デリバティブ	—	—
6	想定元本合計	—	—
公正価値			
7	プラスの公正価値(資産)	—	—
8	マイナスの公正価値(負債)	—	—

(G) CCR8：中央清算機関向けエクスポージャー

(単位：百万円)

項番		2022年度中間期	
		イ	ロ
		中央清算機関向け エクスポージャー (信用リスク削減手法適用後)	リスク・アセットの額
1	適格中央清算機関へのエクスポージャー(合計)	/	845
2	適格中央清算機関に対するトレード・エクスポージャー(当初証拠金を除く。)	27,293	545
3	(i) 派生商品取引(上場以外)	27,293	545
4	(ii) 派生商品取引(上場)	—	—
5	(iii) レポ形式の取引	—	—
6	(iv) クロスプロダクト・ネットtingが承認された場合のネットting・セット	—	—
7	分別管理されている当初証拠金	15,000	/
8	分別管理されていない当初証拠金	15,000	300
9	事前拋出された清算基金	—	—
10	未拋出の清算基金	—	—
11	非適格中央清算機関へのエクスポージャー(合計)	/	—
12	非適格中央清算機関に対するトレード・エクスポージャー(当初証拠金を除く。)	—	—
13	(i) 派生商品取引(上場以外)	—	—
14	(ii) 派生商品取引(上場)	—	—
15	(iii) レポ形式の取引	—	—
16	(iv) クロスプロダクト・ネットtingが承認された場合のネットting・セット	—	—
17	分別管理されている当初証拠金	—	/
18	分別管理されていない当初証拠金	—	—
19	事前拋出された清算基金	—	—
20	未拋出の清算基金	—	—

(単位：百万円)

項番		2023年度中間期	
		イ	ロ
		中央清算機関向け エクスポージャー (信用リスク削減手法適用後)	リスク・アセットの額
1	適格中央清算機関へのエクスポージャー(合計)	/	705
2	適格中央清算機関に対するトレード・エクスポージャー(当初証拠金を除く。)	35,264	705
3	(i) 派生商品取引(上場以外)	35,264	705
4	(ii) 派生商品取引(上場)	—	—
5	(iii) レポ形式の取引	—	—
6	(iv) クロスプロダクト・ネットtingが承認された場合のネットting・セット	—	—
7	分別管理されている当初証拠金	16,500	/
8	分別管理されていない当初証拠金	—	—
9	事前拋出された清算基金	—	—
10	未拋出の清算基金	—	—
11	非適格中央清算機関へのエクスポージャー(合計)	/	—
12	非適格中央清算機関に対するトレード・エクスポージャー(当初証拠金を除く。)	—	—
13	(i) 派生商品取引(上場以外)	—	—
14	(ii) 派生商品取引(上場)	—	—
15	(iii) レポ形式の取引	—	—
16	(iv) クロスプロダクト・ネットtingが承認された場合のネットting・セット	—	—
17	分別管理されている当初証拠金	—	/
18	分別管理されていない当初証拠金	—	—
19	事前拋出された清算基金	—	—
20	未拋出の清算基金	—	—

みずほ信託銀行連結の自己資本の充実の状況

■証券化エクスポージャー

(1) 証券化エクスポージャーに関する定量的開示事項

(A) SEC1：原資産の種類別の証券化エクスポージャー（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）

(単位：百万円)

		2022年度中間期								
		イ			ロ			ハ		
		自金融機関がオリジネーター			自金融機関がスポンサー			自金融機関が投資家		
項番	原資産の種類	資産譲渡型証券化取引	合成型証券化取引	小計	資産譲渡型証券化取引	合成型証券化取引	小計	資産譲渡型証券化取引	合成型証券化取引	小計
1	リテール(合計)	—	—	—	1,500	—	1,500	2,782	—	2,782
2	担保付住宅ローン	—	—	—	—	—	—	2,782	—	2,782
3	クレジットカード債権	—	—	—	1,500	—	1,500	—	—	—
4	その他リテールに係るエクスポージャー	—	—	—	—	—	—	—	—	—
5	再証券化	—	—	—	—	—	—	—	—	—
6	ホールセール(合計)	—	—	—	—	—	—	—	—	—
7	事業法人向けローン	—	—	—	—	—	—	—	—	—
8	商業用モーゲージ担保証券	—	—	—	—	—	—	—	—	—
9	リース債権及び売掛債権	—	—	—	—	—	—	—	—	—
10	その他のホールセール	—	—	—	—	—	—	—	—	—
11	再証券化	—	—	—	—	—	—	—	—	—

(単位：百万円)

		2023年度中間期								
		イ			ロ			ハ		
		自金融機関がオリジネーター			自金融機関がスポンサー			自金融機関が投資家		
項番	原資産の種類	資産譲渡型証券化取引	合成型証券化取引	小計	資産譲渡型証券化取引	合成型証券化取引	小計	資産譲渡型証券化取引	合成型証券化取引	小計
1	リテール(合計)	—	—	—	5,000	—	5,000	2,213	—	2,213
2	担保付住宅ローン	—	—	—	—	—	—	2,213	—	2,213
3	クレジットカード債権	—	—	—	5,000	—	5,000	—	—	—
4	その他リテールに係るエクスポージャー	—	—	—	—	—	—	—	—	—
5	再証券化	—	—	—	—	—	—	—	—	—
6	ホールセール(合計)	—	—	—	—	—	—	—	—	—
7	事業法人向けローン	—	—	—	—	—	—	—	—	—
8	商業用モーゲージ担保証券	—	—	—	—	—	—	—	—	—
9	リース債権及び売掛債権	—	—	—	—	—	—	—	—	—
10	その他のホールセール	—	—	—	—	—	—	—	—	—
11	再証券化	—	—	—	—	—	—	—	—	—

(B) SEC2：原資産の種類別の証券化エクスポージャー（マーケット・リスク相当額の算出対象となっている証券化エクスポージャー）

(単位：百万円)

		2022年度中間期								
		イ			ロ			ハ		
		自金融機関がオリジネーター			自金融機関がスポンサー			自金融機関が投資家		
項番	原資産の種類	資産譲渡型証券化取引	合成型証券化取引	小計	資産譲渡型証券化取引	合成型証券化取引	小計	資産譲渡型証券化取引	合成型証券化取引	小計
1	リテール(合計)	-	-	-	-	-	-	-	-	-
2	担保付住宅ローン	-	-	-	-	-	-	-	-	-
3	クレジットカード債権	-	-	-	-	-	-	-	-	-
4	その他リテールに係るエクスポージャー	-	-	-	-	-	-	-	-	-
5	再証券化	-	-	-	-	-	-	-	-	-
6	ホールセール(合計)	-	-	-	-	-	-	-	-	-
7	事業法人向けローン	-	-	-	-	-	-	-	-	-
8	商業用モーゲージ担保証券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
9	リース債権及び売掛債権	-	-	-	-	-	-	-	-	-
10	その他のホールセール	-	-	-	-	-	-	-	-	-
11	再証券化	-	-	-	-	-	-	-	-	-

(単位：百万円)

		2023年度中間期								
		イ			ロ			ハ		
		自金融機関がオリジネーター			自金融機関がスポンサー			自金融機関が投資家		
項番	原資産の種類	資産譲渡型証券化取引	合成型証券化取引	小計	資産譲渡型証券化取引	合成型証券化取引	小計	資産譲渡型証券化取引	合成型証券化取引	小計
1	リテール(合計)	-	-	-	-	-	-	-	-	-
2	担保付住宅ローン	-	-	-	-	-	-	-	-	-
3	クレジットカード債権	-	-	-	-	-	-	-	-	-
4	その他リテールに係るエクスポージャー	-	-	-	-	-	-	-	-	-
5	再証券化	-	-	-	-	-	-	-	-	-
6	ホールセール(合計)	-	-	-	-	-	-	-	-	-
7	事業法人向けローン	-	-	-	-	-	-	-	-	-
8	商業用モーゲージ担保証券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
9	リース債権及び売掛債権	-	-	-	-	-	-	-	-	-
10	その他のホールセール	-	-	-	-	-	-	-	-	-
11	再証券化	-	-	-	-	-	-	-	-	-

みずほ信託銀行連結の自己資本の充実の状況

(C) SEC3：信用リスク・アセットの額の算出対象となる証券化エクスポージャー及び関連する所要自己資本
(オリジネーター又はスポンサーである場合)

(単位：百万円)

		2022年度中間期							
		イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ	ト	チ
項番	合計	資産譲渡型証券化取引(小計)							
		証券化	証券化		再証券化		シニア		非シニア
			裏付けとなる リート	ホールセール					
エクスポージャーの額(リスク・ウェイト区分別)									
1	20%以下のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	1,500	1,500	1,500	1,500	-	-	-	-
2	20%超50%以下のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	-	-	-	-	-	-	-	-
3	50%超100%以下のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	-	-	-	-	-	-	-	-
4	100%超1250%未満のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	-	-	-	-	-	-	-	-
5	1250%のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	-	-	-	-	-	-	-	-
エクスポージャーの額(算出方法別)									
6	内部格付手法準拠方式又は内部評価方式が適用される証券化エクスポージャー	1,500	1,500	1,500	1,500	-	-	-	-
7	外部格付準拠方式が適用される証券化エクスポージャー	-	-	-	-	-	-	-	-
8	標準的手法準拠方式が適用される証券化エクスポージャー	-	-	-	-	-	-	-	-
9	1250%のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	-	-	-	-	-	-	-	-
信用リスク・アセットの額(算出方法別)									
10	内部格付手法準拠方式又は内部評価方式により算出した信用リスク・アセット	241	241	241	241	-	-	-	-
11	外部格付準拠方式により算出した信用リスク・アセット	-	-	-	-	-	-	-	-
12	標準的手法準拠方式により算出した信用リスク・アセット	-	-	-	-	-	-	-	-
13	1250%のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャーに係る信用リスク・アセット	-	-	-	-	-	-	-	-
所要自己資本の額(算出方法別)									
14	内部格付手法準拠方式又は内部評価方式が適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本	19	19	19	19	-	-	-	-
15	外部格付準拠方式が適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本	-	-	-	-	-	-	-	-
16	標準的手法準拠方式が適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本	-	-	-	-	-	-	-	-
17	1250%のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本	-	-	-	-	-	-	-	-

		2022年度中間期							
		リ	ヌ	ル	ヲ	ワ	カ	ヨ	
項番	合計	合成型証券化取引(小計)							
		証券化	証券化		再証券化		シニア		非シニア
			裏付けとなる リート	ホールセール					
エクスポージャーの額(リスク・ウェイト区分別)									
1	20%以下のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	-	-	-	-	-	-	-	-
2	20%超50%以下のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	-	-	-	-	-	-	-	-
3	50%超100%以下のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	-	-	-	-	-	-	-	-
4	100%超1250%未満のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	-	-	-	-	-	-	-	-
5	1250%のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	-	-	-	-	-	-	-	-
エクスポージャーの額(算出方法別)									
6	内部格付手法準拠方式又は内部評価方式が適用される証券化エクスポージャー	-	-	-	-	-	-	-	-
7	外部格付準拠方式が適用される証券化エクスポージャー	-	-	-	-	-	-	-	-
8	標準的手法準拠方式が適用される証券化エクスポージャー	-	-	-	-	-	-	-	-
9	1250%のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	-	-	-	-	-	-	-	-
信用リスク・アセットの額(算出方法別)									
10	内部格付手法準拠方式又は内部評価方式により算出した信用リスク・アセット	-	-	-	-	-	-	-	-
11	外部格付準拠方式により算出した信用リスク・アセット	-	-	-	-	-	-	-	-
12	標準的手法準拠方式により算出した信用リスク・アセット	-	-	-	-	-	-	-	-
13	1250%のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャーに係る信用リスク・アセット	-	-	-	-	-	-	-	-
所要自己資本の額(算出方法別)									
14	内部格付手法準拠方式又は内部評価方式が適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本	-	-	-	-	-	-	-	-
15	外部格付準拠方式が適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本	-	-	-	-	-	-	-	-
16	標準的手法準拠方式が適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本	-	-	-	-	-	-	-	-
17	1250%のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本	-	-	-	-	-	-	-	-

(単位：百万円)

項番		2023年度中間期															
		イ		ロ		ハ		ニ		ホ		ヘ		ト		チ	
		合計		資産譲渡型 証券化取引 (小計)		証券化		裏付けとなる ホールセール リテール		再証券化		シニア		非シニア			
エクスポージャーの額(リスク・ウェイト区分別)																	
1	20%以下のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
2	20%超50%以下のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	5,000	5,000	5,000	5,000	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
3	50%超100%以下のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
4	100%超1250%未満のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
5	1250%のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
エクスポージャーの額(算出方法別)																	
6	内部格付手法準拠方式又は内部評価方式が適用される証券化エクスポージャー	5,000	5,000	5,000	5,000	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
7	外部格付準拠方式が適用される証券化エクスポージャー	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
8	標準的手法準拠方式が適用される証券化エクスポージャー	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
9	1250%のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
信用リスク・アセットの額(算出方法別)																	
10	内部格付手法準拠方式又は内部評価方式により算出した信用リスク・アセット	1,970	1,970	1,970	1,970	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
11	外部格付準拠方式により算出した信用リスク・アセット	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
12	標準的手法準拠方式により算出した信用リスク・アセット	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
13	1250%のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャーに係る信用リスク・アセット	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
所要自己資本の額(算出方法別)																	
14	内部格付手法準拠方式又は内部評価方式が適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本	157	157	157	157	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
15	外部格付準拠方式が適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
16	標準的手法準拠方式が適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
17	1250%のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—

項番		2023年度中間期															
		リ		ヌ		ル		ヲ		ワ		カ		ヨ			
		合成型証券 化取引 (小計)		証券化		裏付けとなる ホールセール リテール		再証券化		シニア		非シニア					
エクスポージャーの額(リスク・ウェイト区分別)																	
1	20%以下のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
2	20%超50%以下のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
3	50%超100%以下のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
4	100%超1250%未満のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
5	1250%のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
エクスポージャーの額(算出方法別)																	
6	内部格付手法準拠方式又は内部評価方式が適用される証券化エクスポージャー	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
7	外部格付準拠方式が適用される証券化エクスポージャー	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
8	標準的手法準拠方式が適用される証券化エクスポージャー	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
9	1250%のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
信用リスク・アセットの額(算出方法別)																	
10	内部格付手法準拠方式又は内部評価方式により算出した信用リスク・アセット	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
11	外部格付準拠方式により算出した信用リスク・アセット	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
12	標準的手法準拠方式により算出した信用リスク・アセット	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
13	1250%のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャーに係る信用リスク・アセット	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
所要自己資本の額(算出方法別)																	
14	内部格付手法準拠方式又は内部評価方式が適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
15	外部格付準拠方式が適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
16	標準的手法準拠方式が適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
17	1250%のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—

みずほ信託銀行連結の自己資本の充実の状況

(D) SEC4：信用リスク・アセットの額の算出対象となる証券化エクスポージャー及び関連する所要自己資本
(投資家である場合)

(単位：百万円)

		2022年度中間期							
		イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ	ト	チ
合計		資産譲渡型 証券化取引 (小計)		証券化		再証券化			
				裏付けとなる リート	ホールセール			シニア	非シニア
項番									
エクスポージャーの額(リスク・ウェイト区分別)									
1	20%以下のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	2,782	2,782	2,782	2,782	-	-	-	-
2	20%超50%以下のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	-	-	-	-	-	-	-	-
3	50%超100%以下のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	-	-	-	-	-	-	-	-
4	100%超1250%未満のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	-	-	-	-	-	-	-	-
5	1250%のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	-	-	-	-	-	-	-	-
エクスポージャーの額(算出方法別)									
6	内部格付手法準拠方式又は内部評価方式が適用される証券化エクスポージャー	2,782	2,782	2,782	2,782	-	-	-	-
7	外部格付準拠方式が適用される証券化エクスポージャー	-	-	-	-	-	-	-	-
8	標準的手法準拠方式が適用される証券化エクスポージャー	-	-	-	-	-	-	-	-
9	1250%のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	-	-	-	-	-	-	-	-
信用リスク・アセットの額(算出方法別)									
10	内部格付手法準拠方式又は内部評価方式により算出した信用リスク・アセット	417	417	417	417	-	-	-	-
11	外部格付準拠方式により算出した信用リスク・アセット	-	-	-	-	-	-	-	-
12	標準的手法準拠方式により算出した信用リスク・アセット	-	-	-	-	-	-	-	-
13	1250%のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャーに係る信用リスク・アセット	-	-	-	-	-	-	-	-
所要自己資本の額(算出方法別)									
14	内部格付手法準拠方式又は内部評価方式が適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本	33	33	33	33	-	-	-	-
15	外部格付準拠方式が適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本	-	-	-	-	-	-	-	-
16	標準的手法準拠方式が適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本	-	-	-	-	-	-	-	-
17	1250%のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本	-	-	-	-	-	-	-	-

		2022年度中間期							
		リ	ヌ	ル	ヲ	ワ	カ	ヨ	
		合成型証券 化取引 (小計)		証券化		再証券化			
				裏付けとなる リート	ホールセール			シニア	非シニア
項番									
エクスポージャーの額(リスク・ウェイト区分別)									
1	20%以下のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	-	-	-	-	-	-	-	-
2	20%超50%以下のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	-	-	-	-	-	-	-	-
3	50%超100%以下のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	-	-	-	-	-	-	-	-
4	100%超1250%未満のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	-	-	-	-	-	-	-	-
5	1250%のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	-	-	-	-	-	-	-	-
エクスポージャーの額(算出方法別)									
6	内部格付手法準拠方式又は内部評価方式が適用される証券化エクスポージャー	-	-	-	-	-	-	-	-
7	外部格付準拠方式が適用される証券化エクスポージャー	-	-	-	-	-	-	-	-
8	標準的手法準拠方式が適用される証券化エクスポージャー	-	-	-	-	-	-	-	-
9	1250%のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	-	-	-	-	-	-	-	-
信用リスク・アセットの額(算出方法別)									
10	内部格付手法準拠方式又は内部評価方式により算出した信用リスク・アセット	-	-	-	-	-	-	-	-
11	外部格付準拠方式により算出した信用リスク・アセット	-	-	-	-	-	-	-	-
12	標準的手法準拠方式により算出した信用リスク・アセット	-	-	-	-	-	-	-	-
13	1250%のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャーに係る信用リスク・アセット	-	-	-	-	-	-	-	-
所要自己資本の額(算出方法別)									
14	内部格付手法準拠方式又は内部評価方式が適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本	-	-	-	-	-	-	-	-
15	外部格付準拠方式が適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本	-	-	-	-	-	-	-	-
16	標準的手法準拠方式が適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本	-	-	-	-	-	-	-	-
17	1250%のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本	-	-	-	-	-	-	-	-

(単位：百万円)

項番		2023年度中間期							
		イ ロ ハ ニ ホ ヘ ト チ							
		合計	資産譲渡型 証券化取引 (小計)	証券化	裏付けとなる		再証券化	シニア	非シニア
ホールセール	リテール								
エクスポージャーの額(リスク・ウェイト区分別)									
1	20%以下のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	2,213	2,213	2,213	2,213	—	—	—	—
2	20%超50%以下のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	—	—	—	—	—	—	—	—
3	50%超100%以下のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	—	—	—	—	—	—	—	—
4	100%超1250%未満のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	—	—	—	—	—	—	—	—
5	1250%のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	—	—	—	—	—	—	—	—
エクスポージャーの額(算出方法別)									
6	内部格付手法準拠方式又は内部評価方式が適用される証券化エクスポージャー	2,213	2,213	2,213	2,213	—	—	—	—
7	外部格付準拠方式が適用される証券化エクスポージャー	—	—	—	—	—	—	—	—
8	標準的手法準拠方式が適用される証券化エクスポージャー	—	—	—	—	—	—	—	—
9	1250%のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	—	—	—	—	—	—	—	—
信用リスク・アセットの額(算出方法別)									
10	内部格付手法準拠方式又は内部評価方式により算出した信用リスク・アセット	332	332	332	332	—	—	—	—
11	外部格付準拠方式により算出した信用リスク・アセット	—	—	—	—	—	—	—	—
12	標準的手法準拠方式により算出した信用リスク・アセット	—	—	—	—	—	—	—	—
13	1250%のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャーに係る信用リスク・アセット	—	—	—	—	—	—	—	—
所要自己資本の額(算出方法別)									
14	内部格付手法準拠方式又は内部評価方式が適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本	26	26	26	26	—	—	—	—
15	外部格付準拠方式が適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本	—	—	—	—	—	—	—	—
16	標準的手法準拠方式が適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本	—	—	—	—	—	—	—	—
17	1250%のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本	—	—	—	—	—	—	—	—

項番		2023年度中間期							
		リ ヌ ル ヲ ワ カ ヨ							
		合成型証券 化取引 (小計)	証券化	裏付けとなる		再証券化	シニア	非シニア	
ホールセール	リテール								
エクスポージャーの額(リスク・ウェイト区分別)									
1	20%以下のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	—	—	—	—	—	—	—	—
2	20%超50%以下のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	—	—	—	—	—	—	—	—
3	50%超100%以下のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	—	—	—	—	—	—	—	—
4	100%超1250%未満のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	—	—	—	—	—	—	—	—
5	1250%のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	—	—	—	—	—	—	—	—
エクスポージャーの額(算出方法別)									
6	内部格付手法準拠方式又は内部評価方式が適用される証券化エクスポージャー	—	—	—	—	—	—	—	—
7	外部格付準拠方式が適用される証券化エクスポージャー	—	—	—	—	—	—	—	—
8	標準的手法準拠方式が適用される証券化エクスポージャー	—	—	—	—	—	—	—	—
9	1250%のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	—	—	—	—	—	—	—	—
信用リスク・アセットの額(算出方法別)									
10	内部格付手法準拠方式又は内部評価方式により算出した信用リスク・アセット	—	—	—	—	—	—	—	—
11	外部格付準拠方式により算出した信用リスク・アセット	—	—	—	—	—	—	—	—
12	標準的手法準拠方式により算出した信用リスク・アセット	—	—	—	—	—	—	—	—
13	1250%のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャーに係る信用リスク・アセット	—	—	—	—	—	—	—	—
所要自己資本の額(算出方法別)									
14	内部格付手法準拠方式又は内部評価方式が適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本	—	—	—	—	—	—	—	—
15	外部格付準拠方式が適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本	—	—	—	—	—	—	—	—
16	標準的手法準拠方式が適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本	—	—	—	—	—	—	—	—
17	1250%のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本	—	—	—	—	—	—	—	—

みずほ信託銀行連結の自己資本の充実の状況

■マーケット・リスク

(1) トレーディング業務

(A) MR1：標準的方式によるマーケット・リスク相当額

(単位：百万円)

項番	2022年度中間期		2023年度中間期	
	リスク・アセット (リスク相当額を8%で除して得た額)		リスク・アセット (リスク相当額を8%で除して得た額)	
1	金利リスク(一般市場リスク及び個別リスク)の額		—	—
2	株式リスク(一般市場リスク及び個別リスク)の額		—	—
3	外国為替リスクの額		1,176	1,081
4	コモディティ・リスクの額		—	—
	オプション取引			
5	簡便法により算出した額		—	—
6	デルタ・プラス法により算出した額		—	—
7	シナリオ法により算出した額		—	—
8	証券化エクスポージャーに係る個別リスクの額		—	—
9	合計		1,176	1,081

(2) バンキング業務

(A) IRRBB1：金利リスク

(単位：百万円)

項番	イ		ロ		ハ		ニ	
	ΔEVE				ΔNII			
	2023年度中間期		2022年度中間期		2023年度中間期		2022年度中間期	
1	上方パラレルシフト		0	3,445	△21,789	△20,922		
2	下方パラレルシフト		3,609	1	20,242	19,577		
3	スティープ化		1,698	3,701	/	/		
4	フラット化		0	27	/	/		
5	短期金利上昇		0	35	/	/		
6	短期金利低下		2,522	1,483	/	/		
7	最大値		3,609	3,701	20,242	19,577		
			ホ		へ			
			2023年度中間期		2022年度中間期			
8	Tier1資本の額		471,524		453,345			

- 注) 1. 経済的価値・金利収益が減少する方向をプラスで表記しています。
 2. 明確な金利改定間隔がなく、預金者の要求によって随時払い出される当座預金や普通預金等の一部では、コア預金として認識の上、適切な方法により計測を行っています。金利改定の平均満期は、円預金0.3年となります。最長の金利改定満期は、円預金4.5年となります。また、定期預金や貸出等は、返済・解約実績等を踏まえ期限前解約率を推定し、適切な方法により計測を行っています。
 3. ΔEVE及びΔNIIともに計測対象はJPYのみとなります。JPY以外の金利リスクについては僅少であり、複数通貨の集計はしていません。
 4. ΔEVE、ΔNIIの計測にあたり、割引金利や参照金利に応じて適切な金利やスプレッドを設定しています。
 5. 算出にあたり、規制で定められた金利ショック等の前提を用いています。

■連結レバレッジ比率の構成に関する事項

(1) レバレッジ比率の構成に関する事項

(単位：百万円、%)

国際様式(表2) の該当番号	国際様式(表1) の該当番号	項目	2022年度中間期	2023年度中間期
1. オン・バランス資産の額				
1		調整項目控除前のオン・バランス資産の額	4,112,942	3,881,644
1a	1	連結貸借対照表における総資産の額	4,167,086	3,970,297
1b	2	連結レバレッジ比率の範囲に含まれない子法人等の資産の額(△)	—	—
1c	7	連結レバレッジ比率の範囲に含まれる子会社の資産の額(連結貸借対照表における総資産の額に含まれる額を除く。)	—	—
1d	3	連結貸借対照表における総資産の額から控除される調整項目以外の資産の額(△)	54,143	88,652
2	7	Tier 1 資本に係る調整項目の額(△)	93,018	115,865
3		オン・バランス資産の額	(イ) 4,019,924	3,765,779
2. デリバティブ取引等に関する額				
4		デリバティブ取引等に関するRCの額に1.4を乗じた額	—	—
		デリバティブ取引等に関する再構築コストの額	13,982	21,676
5		デリバティブ取引等に関するPFEの額に1.4を乗じた額	—	—
		デリバティブ取引等に関するアドオンの額	13,310	13,588
		デリバティブ取引等に関連して現金で差し入れた証拠金の対価の額	846	—
6		連結貸借対照表から控除されているデリバティブ取引等に関連して差し入れた担保の対価の額	—	—
		連結貸借対照表から控除されているデリバティブ取引等に関連して現金で差し入れた証拠金の対価の額	—	—
7		デリバティブ取引等に関連して現金で差し入れた変動証拠金の対価の額のうち控除する額(△)	—	—
8		清算会員である銀行が補償を義務付けられていない顧客とのトレード・エクスポージャーの額(△)	/	/
9		クレジット・デリバティブのプロテクションを提供した場合における調整後想定元本の額	—	—
10		クレジット・デリバティブのプロテクションを提供した場合における調整後想定元本の額から控除した額(△)	—	—
11	4	デリバティブ取引等に関する額	(ロ) 28,140	35,264
3. レポ取引等に関する額				
12		レポ取引等に関する資産の額	20,038	40,318
13		レポ取引等に関する資産の額から控除した額(△)	—	—
14		レポ取引等に関するカウンターパーティ・リスクのエクスポージャーの額	12	110
15		代理取引のエクスポージャーの額	/	/
16	5	レポ取引等に関する額	(ハ) 20,051	40,428
4. オフ・バランス取引に関する額				
17		オフ・バランス取引の想定元本の額	482,318	480,716
18		オフ・バランス取引に係るエクスポージャーの額への変換調整の額(△)	259,807	251,189
19	6	オフ・バランス取引に関する額	(ニ) 222,511	229,527
5. 連結レバレッジ比率				
20		資本の額	(ホ) 453,345	471,524
21	8	総エクスポージャーの額((イ)+(ロ)+(ハ)+(ニ))	(ヘ) 4,290,626	4,070,999
22		連結レバレッジ比率(ホ)/(ヘ)	10.56%	11.58%
		適用する所要連結レバレッジ比率	/	3.00%
6. 日本銀行に対する預け金を算入する場合の連結レバレッジ比率				
		総エクスポージャーの額	(ヘ) 4,290,626	4,070,999
		日本銀行に対する預け金の額	2,185,131	2,439,513
		日本銀行に対する預け金を算入する場合の総エクスポージャーの額 (ヘ')	6,475,758	6,510,513
		日本銀行に対する預け金を算入する場合の連結レバレッジ比率(ホ)/(ヘ')	7.00%	7.24%

注) 当行は、連結レバレッジ比率の算定に関する外部監査として、日本公認会計士協会専門業務実務指針4465「自己資本比率及びレバレッジ比率の算定に対する合意された手続業務に関する実務指針」に基づく合意された手続業務を、EY新日本有限責任監査法人により受けています。なお、当該業務は、連結財務諸表の監査又は財務報告に係る内部統制の監査の一部ではありません。当該業務は、レバレッジ比率そのものやレバレッジ比率の算定に係る内部管理体制について意見又は結論を表明するものではなく、当行と合意した範囲において手続をEY新日本有限責任監査法人が実施し、当行に対しその結果を報告するものです。

前中間連結会計年度の連結レバレッジ比率との間に著しい差異を生じた原因

貸出金の減少等により、総エクスポージャーが減少したものの。

みずほ信託銀行連結の流動性に係る経営の健全性の状況

「銀行法施行規則第19条の2第1項第5号ホ等の規定に基づき、経営の健全性の状況について金融庁長官が別に定める事項のうち、流動

性に係る健全性を判断するための基準に係る事項」(平成27年金融庁告示第7号)に基づき、開示しています。

■流動性カバレッジ比率

(1) 連結流動性カバレッジ比率に関する定量的開示事項

(単位：百万円、%、件)

項目	2023年度第1四半期		2023年度第2四半期	
適格流動資産 (1)	/		/	
1 適格流動資産の合計額	2,915,526		2,668,457	
資金流出額 (2)	資金流出率を乗じる前の額	資金流出率を乗じた後の額	資金流出率を乗じる前の額	資金流出率を乗じた後の額
2 リテール無担保資金調達に係る資金流出額	1,533,522	135,354	1,521,528	134,387
3 うち、安定預金の額	258,432	7,752	254,983	7,649
4 うち、準安定預金の額	1,275,089	127,601	1,266,545	126,738
5 ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	2,091,141	1,774,398	2,088,667	1,807,801
6 うち、適格オペレーショナル預金の額	—	—	—	—
7 うち、適格オペレーショナル預金及び負債性有価証券以外のホールセール無担保資金調達に係る資金の額	2,032,966	1,716,222	1,991,121	1,710,255
8 うち、負債性有価証券の額	58,175	58,175	97,545	97,545
9 有担保資金調達等に係る資金流出額	/	—	/	—
10 デリバティブ取引等、資金調達プログラム及び与信・流動性ファシリティに係る資金流出額	409,640	94,456	403,378	90,669
11 うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	20,038	20,038	20,046	20,046
12 うち、資金調達プログラムに係る資金流出額	—	—	—	—
13 うち、与信・流動性ファシリティに係る資金流出額	389,602	74,418	383,332	70,623
14 資金提供義務に基づく資金流出額等	18,315	15,871	5,753	5,730
15 偶発事象に係る資金流出額	1,008,209	1,599	1,040,590	1,547
16 資金流出合計額	/	2,021,680	/	2,040,136
資金流入額 (3)	資金流入率を乗じる前の額	資金流入率を乗じた後の額	資金流入率を乗じる前の額	資金流入率を乗じた後の額
17 有担保資金運用等に係る資金流入額	90,101	—	16,795	—
18 貸付金等の回収に係る資金流入額	211,886	150,195	222,808	155,092
19 その他資金流入額	21,596	13,004	11,010	2,050
20 資金流入合計額	323,584	163,199	250,613	157,143
連結流動性カバレッジ比率 (4)	/		/	
21 算入可能適格流動資産の合計額	2,915,526		2,668,457	
22 純資金流出額	1,858,481		1,882,992	
23 連結流動性カバレッジ比率	157.6%		142.5%	
24 平均値計算用データ数	62		62	

(2) 連結流動性カバレッジ比率に関する定性的開示事項

(A) 時系列における連結流動性カバレッジ比率の変動に関する事項

当行の連結LCRは、過去2年間安定的に推移しています。

(B) 連結流動性カバレッジ比率の水準の評価に関する事項

当行の連結LCRは、規制水準(100%)を上回っており、特段の問題はないものと評価しています。

なお、今後の連結LCRの見通しが開示された比率と大きく乖離することは想定していません。

また、連結LCRの実績値は当初の見通しと大きく異なっていません。

(C) 算入可能適格流動資産の合計額の内容に関する事項

算入可能適格流動資産の通貨又は種類等の構成や所在地に著しい変動はありません。

なお、主要な通貨(通貨建て負債合計額が当行の負債合計額の5%以上を占める通貨)において、算入可能適格流動資産の合計額と純資金流出額の間に、著しい通貨のミスマッチはありません。

(D) その他連結流動性カバレッジ比率に関する事項

当行の連結LCRは、告示第60号第29条の「適格オペレーショナル預金に係る特例」及び同告示第60号第38条の「シナリオ法による時価変動時所要追加担保額」を適用していません。

告示第60号第60条の「その他契約に基づく資金流出額」には、「小規模連結子法人に係る資金流出額」等を計上しています。

なお、告示第60号第53条の「その他偶発事象に係る資金流出額」、告示第60号第73条の「その他契約に基づく資金流入額」について開示が必要となる重要な項目はありません。

連結子会社に関するデータ等については、月次データもしくは四半期データを使用しています。

■安定調達比率

(1) 連結安定調達比率に関する定量的開示事項

(単位：百万円、%)

項番		2023年度第1四半期					2023年度第2四半期				
		算入率考慮前金額				算入率考慮後金額	算入率考慮前金額				算入率考慮後金額
		満期なし	6月末満	6月以上1年未満	1年以上		満期なし	6月末満	6月以上1年未満	1年以上	
利用可能安定調達額 (1)											
1	資本の額	577,752	—	—	—	577,752	597,909	—	—	—	597,909
2	うち、普通株式等Tier1資本、その他Tier1資本及びTier2資本(基準日から1年を経過する前に弁済期が到来するものを除く。)に係る基礎項目の額	577,752	—	—	—	577,752	597,909	—	—	—	597,909
3	うち、上記に含まれない資本調達手段及び資本の額	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
4	個人及び中小企業等からの資金調達	1,525,494	—	—	—	1,385,751	1,513,704	—	—	—	1,375,044
5	うち、安定預金等の額	256,126	—	—	—	243,319	254,210	—	—	—	241,499
6	うち、準安定預金等の額	1,269,367	—	—	—	1,142,431	1,259,494	—	—	—	1,133,544
7	ホールセール資金調達	703,108	2,586,843	618,611	671,631	1,676,291	657,115	2,370,211	600,147	605,055	1,514,427
8	うち、適格オペレーショナル預金の額	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
9	うち、その他のホールセール資金調達の額	703,108	2,586,843	618,611	671,631	1,676,291	657,115	2,370,211	600,147	605,055	1,514,427
10	相互に関係する資産がある負債	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
11	その他の負債	87,997	—	—	—	21,511	81,817	—	—	—	21,566
12	うち、デリバティブ負債の額	/	/	/	—	/	/	/	/	—	/
13	うち、上記に含まれない負債の額	87,997	—	—	—	21,511	81,817	—	—	—	21,566
14	利用可能安定調達額合計	/	/	/	/	3,661,306	/	/	/	/	3,508,947
所要安定調達額 (2)											
15	流動資産の額	/	/	/	/	66,228	/	/	/	/	67,470
16	金融機関等に預け入れているオペレーショナル預金に相当するものの額	5,388	—	—	—	2,694	5,472	—	—	—	2,736
17	貸出金又はレボ形式の取引による資産及び有価証券その他これに類するものの額	246,277	717,857	265,210	2,443,226	2,595,241	192,394	516,638	186,431	2,423,611	2,432,797
18	うち、レベル1資産を担保とする金融機関等への貸出金及びレボ形式の取引による額	—	280,318	—	—	130,104	—	40,318	—	—	—
19	うち、項番18に含まれない金融機関等への貸出金及びレボ形式の取引による額	216,386	138,332	39,326	310,415	383,919	150,327	134,283	22,820	330,450	384,735
20	うち、貸出金又はレボ形式の取引による資産の額(項番18、19及び22に該当する額を除く。)	299	297,993	189,835	2,043,397	1,965,143	304	340,866	127,609	2,006,095	1,923,555
21	うち、リスク・ウェイトが35%以下の資産の額	—	1,355	2,316	80,993	54,482	—	2,496	436	82,019	54,779
22	うち、住宅ローン債権	—	1,014	998	19,869	14,186	—	998	975	19,222	13,742
23	うち、リスク・ウェイトが35%以下の資産の額	—	934	919	18,545	12,981	—	919	898	17,921	12,557
24	うち、流動資産に該当しない有価証券その他これに類するもの	29,591	197	35,048	69,544	101,888	41,762	171	35,025	67,842	110,763
25	相互に関係する負債がある資産	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
26	その他の資産等	438,219	1,601	566	33,568	471,479	446,425	886	469	16,700	464,362
27	うち、現物決済されるコモディティ(金を含む。)	—	/	/	/	—	—	/	/	/	—
28	うち、デリバティブ取引等又は中央清算機関との取引に関連して預託した当初証拠金又は清算基金(連結貸借対照表に計上されないものを含む。)	/	/	/	16,500	14,025	/	/	/	—	—
29	うち、デリバティブ資産の額	/	/	/	803	803	/	/	/	511	511
30	うち、デリバティブ負債(変動証拠金の対価の額を減する前)の額	/	/	/	—	—	/	/	/	—	—
31	うち、上記に含まれない資産及び資本の額	438,219	1,601	566	16,265	456,651	446,425	886	469	16,188	463,850
32	オフ・バランス取引	/	/	/	1,422,943	20,972	/	/	/	1,403,207	20,554
33	所要安定調達額合計	/	/	/	/	3,156,617	/	/	/	/	2,987,921
34	連結安定調達比率	/	/	/	/	115.9%	/	/	/	/	117.4%

みずほ信託銀行連結の流動性に係る経営の健全性の状況

(2) 連結安定調達比率に関する定性的開示事項

(A) 時系列における連結安定調達比率の変動に関する事項

当行の連結NSFRは、2021年9月末の規制適用以降、安定的に推移しています。

(B) 相互に関係する資産・負債の特例に関する事項

当行の連結NSFRは、告示第60号第101条に定める「相互に関係する資産・負債の特例」を適用していません。

(C) その他連結安定調達比率に関する事項

当行の連結NSFRは、規制水準(100%)を上回っており、特段の問題はないものと評価しています。

なお、今後の連結NSFRの見通しが開示された比率と大きく乖離することは想定していません。

また、連結NSFRの実績値は当初の見通しと大きく異なっておりません。

みずほ信託銀行単体の主要な指標

バーゼル銀行監督委員会の合意に基づく自己資本比率規制では、自己資本比率等の最低水準を充足することが求められています。

当行は、「銀行法第14条の2の規定に基づき、銀行がその保有する資産等に照らし自己資本の充実の状況が適当であるかどうかを判断するための基準」（平成18年金融庁告示第19号）に基づき、単体自己資本比率を算出しています。

また、当行は、「銀行法第14条の2の規定に基づき、銀行がその保有する資産等に照らし自己資本の充実の状況が適当であるかどうかを判断するための基準の補完的指標として定めるレバレッジに係る健全性を判断するための基準」（平成31年金融庁告示第11号）に基づき、単体レバレッジ比率を算出しています。

バーゼル銀行監督委員会の合意に基づく流動性比率規制では、流動性カバレッジ比率及び安定調達比率の最低水準を充足することが求められています。当行は、「銀行法第14条の2の規定に基づき、銀行がその経営の健全性を判断するための基準として定める流動性に係る健全性を判断するための基準」（平成26年金融庁告示第60号、以下「告示第60号」）に基づき、単体流動性カバレッジ比率（以下「単体LCR」）及び単体安定調達比率（以下「単体NSFR」）を算出しています。

■主要な指標

KM1：主要な指標

(単位：百万円、%)

国際様式の 該当番号		イ	ロ	ハ	ニ	ホ
		2023年度 第2四半期末	2023年度 第1四半期末	2022年度 第4四半期末	2022年度 第3四半期末	2022年度 第2四半期末
資本						
1	普通株式等Tier 1資本の額	447,032	439,663	425,277	446,792	436,362
2	Tier 1資本の額	447,032	439,663	425,277	446,792	436,362
3	総自己資本の額	447,171	439,793	425,443	446,845	436,411
リスク・アセット						
4	リスク・アセットの額	1,639,465	1,640,083	1,693,913	1,640,101	1,698,733
自己資本比率						
5	普通株式等Tier 1比率	27.26%	26.80%	25.10%	27.24%	25.68%
6	Tier 1比率	27.26%	26.80%	25.10%	27.24%	25.68%
7	総自己資本比率	27.27%	26.81%	25.11%	27.24%	25.69%
単体レバレッジ比率						
13	総エクスポージャーの額	3,968,132	4,264,391	4,073,301	4,182,750	4,166,243
14	単体レバレッジ比率	11.26%	10.31%	10.44%	10.68%	10.47%
単体流動性カバレッジ比率						
15	算入可能適格流動性資産の合計額	2,591,104	2,835,989	2,629,418	2,206,514	2,188,569
16	純資金流出額	1,793,613	1,758,834	2,020,301	1,650,241	1,534,025
17	単体流動性カバレッジ比率	145.3%	162.2%	130.3%	135.1%	144.1%
単体安定調達比率						
18	利用可能安定調達額	3,445,147	3,598,870	3,473,103	3,453,082	3,488,550
19	所要安定調達額	2,928,385	3,093,557	3,006,771	3,097,830	3,084,197
20	単体安定調達比率	117.6%	116.3%	115.5%	111.4%	113.1%

注) 項番15～17には四半期平均値を記載しています。

みずほ信託銀行単体の自己資本の充実の状況

■自己資本

(1) 自己資本の構成等

(A) CC1：自己資本の構成

(単位：百万円、%)

国際様式の 該当番号	項目	イ 2022年度 中間期	ロ 2023年度 中間期	ハ 別紙様式第十三号 (CC2) の参照項目
普通株式等Tier1資本に係る基礎項目 (1)				
1a+2-1c-26	普通株式に係る株主資本の額	443,832	439,247	
1a	うち資本金及び資本剰余金の額	262,874	262,874	
2	うち利益剰余金の額	260,957	256,372	
1c	うち自己株式の額(△)	79,999	79,999	
26	うち社外流出予定額(△)	—	—	
	うち上記以外に該当するものの額	—	—	
1b	普通株式に係る新株予約権の額	—	—	
3	評価・換算差額等及びその他公表準備金の額	60,871	85,794	(a)
6	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	(イ) 504,704	525,041	
普通株式等Tier1資本に係る調整項目 (2)				
8+9	無形固定資産(モーゲージ・サービシング・ライツに係るものを除く。)の額の合計額	13,700	13,034	
8	うちのれんに係るものの額	249	206	
9	うちのれん及びモーゲージ・サービシング・ライツに係るもの以外のものの額	13,450	12,828	
10	繰延税金資産(一時差異に係るものを除く。)の額	—	—	
11	繰延ヘッジ損益の額	4,546	10,367	
12	適格引当金不足額	1,455	2,267	
13	証券化取引に伴い増加した自己資本に相当する額	—	—	
14	負債の時価評価により生じた時価評価差額であって自己資本に算入される額	—	—	
15	前払年金費用の額	48,640	52,339	
16	自己保有普通株式(純資産の部に計上されるものを除く。)の額	—	—	
17	意図的に保有している他の金融機関等の普通株式の額	—	—	
18	少数出資金融機関等の普通株式の額	—	—	
19+20+21	特定項目に係る10%基準超過額	—	—	
19	うちその他金融機関等に係る対象資本等調達手段のうち普通株式に該当するものに関するものの額	—	—	
20	うち無形固定資産(モーゲージ・サービシング・ライツに係るものに限る。)に関連するものの額	—	—	
21	うち繰延税金資産(一時差異に係るものに限る。)に関連するものの額	—	—	
22	特定項目に係る15%基準超過額	—	—	
23	うちその他金融機関等に係る対象資本等調達手段のうち普通株式に該当するものに関するものの額	—	—	
24	うち無形固定資産(モーゲージ・サービシング・ライツに係るものに限る。)に関連するものの額	—	—	
25	うち繰延税金資産(一時差異に係るものに限る。)に関連するものの額	—	—	
27	その他Tier1資本不足額	—	—	
28	普通株式等Tier1資本に係る調整項目の額	(ロ) 68,341	78,008	
普通株式等Tier1資本				
29	普通株式等Tier1資本の額((イ)-(ロ))	(ハ) 436,362	447,032	

(次ページへ続く)

(続き)

(単位：百万円、%)

国際様式の 該当番号	項目		イ 2022年度 中間期	ロ 2023年度 中間期	ハ 別紙様式第十三号 (CC2) の参照項目
その他Tier1 資本に係る基礎項目		(3)			
30 31a	その他Tier1 資本調達手段に係る株主資本の額及びその内訳		—	—	
30 31b	その他Tier1 資本調達手段に係る新株予約権の額		—	—	
30 32	その他Tier1 資本調達手段に係る負債の額		—	—	
30	特別目的会社等の発行するその他Tier1 資本調達手段の額		—	—	
33+35	適格旧Tier1 資本調達手段の額のうちその他Tier1 資本に係る基礎項目の額に含まれる額		/	/	
36	その他Tier1 資本に係る基礎項目の額	(二)	—	—	
その他Tier1 資本に係る調整項目					
37	自己保有その他Tier1 資本調達手段の額		—	—	
38	意図的に保有している他の金融機関等のその他Tier1 資本調達手段の額		—	—	
39	少数出資金融機関等のその他Tier1 資本調達手段の額		—	—	
40	その他金融機関等のその他Tier1 資本調達手段の額		—	—	
42	Tier2資本不足額		—	—	
43	その他Tier1 資本に係る調整項目の額	(ホ)	—	—	
その他Tier1 資本					
44	その他Tier1 資本の額((二) - (ホ))	(ヘ)	—	—	
Tier1 資本					
45	Tier1 資本の額((ハ) + (ヘ))	(ト)	436,362	447,032	
Tier2資本に係る基礎項目		(4)			
46	Tier2資本調達手段に係る株主資本の額及びその内訳		—	—	
46	Tier2資本調達手段に係る新株予約権の額		—	—	
46	Tier2資本調達手段に係る負債の額		—	—	
46	特別目的会社等の発行するTier2資本調達手段の額		—	—	
47+49	適格旧Tier2資本調達手段の額のうちTier2資本に係る基礎項目の額に含まれる額		/	/	
50	一般貸倒引当金Tier2算入額及び適格引当金Tier2算入額の合計額		48	138	
50a	うち一般貸倒引当金Tier2算入額		48	138	
50b	うち適格引当金Tier2算入額		—	—	
51	Tier2資本に係る基礎項目の額	(チ)	48	138	

(次ページへ続く)

みずほ信託銀行単体の自己資本の充実の状況

(続き)

(単位：百万円、%)

国際様式の 該当番号	項目		イ 2022年度 中間期	ロ 2023年度 中間期	ハ 別紙様式第十三号 (CC2) の参照項目
Tier2資本に係る調整項目		(5)			
52	自己保有Tier2資本調達手段の額		—	—	
53	意図的に保有している他の金融機関等のTier2資本調達手段及びその他外部TLAC関連調達手段の額		—	—	
54	少数出資金融機関等のTier2資本調達手段及びその他外部TLAC関連調達手段の額		—	—	
55	その他金融機関等のTier2資本調達手段及びその他外部TLAC関連調達手段の額		—	—	
57	Tier2資本に係る調整項目の額	(リ)	—	—	
Tier2資本					
58	Tier2資本の額((チ)-(リ))	(ヌ)	48	138	
総自己資本					
59	総自己資本の額((ト)+(ヌ))	(ル)	436,411	447,171	
リスク・アセット		(6)			
60	リスク・アセットの額	(ヲ)	1,698,733	1,639,465	
自己資本比率		(7)			
61	普通株式等Tier1比率((ハ)/(ヲ))		25.68%	27.26%	
62	Tier1比率((ト)/(ヲ))		25.68%	27.26%	
63	総自己資本比率((ル)/(ヲ))		25.69%	27.27%	
調整項目に係る参考事項		(8)			
72	少数出資金融機関等の対象資本等調達手段に係る調整項目不算入額		8,013	10,724	
73	その他金融機関等に係る対象資本等調達手段のうち普通株式に係る調整項目不算入額		598	345	
74	無形固定資産(モーゲージ・サービシング・ライツに係るものに限る。)に係る調整項目不算入額		—	—	
75	繰延税金資産(一時差異に係るものに限る。)に係る調整項目不算入額		5,845	—	
Tier2資本に係る基礎項目の額に算入される引当金に関する事項		(9)			
76	一般貸倒引当金の額		48	138	
77	一般貸倒引当金に係るTier2資本算入上限額		423	973	
78	内部格付手法採用行において、適格引当金の合計額から事業法人等向けエクスポージャー及びリテール向けエクスポージャーの期待損失額の合計額を控除した額(当該額が零を下回る場合にあっては、零とする。)		—	—	
79	適格引当金に係るTier2資本算入上限額		8,314	7,753	
資本調達手段に係る経過措置に関する事項		(10)			
82	適格旧Tier1資本調達手段に係る算入上限額		/	/	
83	適格旧Tier1資本調達手段の額から適格旧Tier1資本調達手段に係る算入上限額を控除した額(当該額が零を下回る場合にあっては、零とする。)		/	/	
84	適格旧Tier2資本調達手段に係る算入上限額		/	/	
85	適格旧Tier2資本調達手段の額から適格旧Tier2資本調達手段に係る算入上限額を控除した額(当該額が零を下回る場合にあっては、零とする。)		/	/	

注) 1. 上記は「銀行法第14条の2の規定に基づき、銀行がその保有する資産等に照らし自己資本の充実の状況が適当であるかどうかを判断するための基準」(平成18年金融庁告示第19号。以下、「告示」という。)に基づいて算出したものであり、国際統一基準を採用した単体ベースの計数となっています。
 2. 当行は、単体自己資本比率の算定に関する外部監査として、日本公認会計士協会専門業務実務指針 4465「自己資本比率及びレバレッジ比率の算定に対する合意された手続業務に関する実務指針」に基づく合意された手続業務を、EY新日本有限責任監査法人により受けています。なお、当該業務は、財務諸表の監査又は財務報告に係る内部統制の監査の一部ではありません。当該業務は自己資本比率そのものや自己資本比率の算定に係る内部管理体制について意見又は結論を表明するものではなく、当行と合意した範囲において手続をEY新日本有限責任監査法人が実施し、当行に対しその結果を報告するものです。

(B) CC2：中間貸借対照表の科目と自己資本の構成に関する開示項目の対応関係

(単位：百万円)

項目	(イ)		(ロ)		別紙様式第一号を参照する番号又は記号	二 付表を参照する番号又は記号
	公表		公表			
	中間貸借対照表 2022年度中間期	中間貸借対照表 2023年度中間期	中間貸借対照表 2022年度中間期	中間貸借対照表 2023年度中間期		
(資産の部)						
現金預け金	2,197,534		2,455,687			
債券貸借取引支払保証金	20,038		40,318			
買入金銭債権	41,199		39,541			
金銭の信託	28,154		26,001			
有価証券	284,656		277,252			6-b
貸出金	3,143,912		2,946,923			6-c
外国為替	4,845		6,336			
その他資産	258,176		228,315			6-d
有形固定資産	98,991		92,644			
無形固定資産	19,636		18,695			2
前払年金費用	70,107		75,438			3
支払承諾見返	13,577		13,909			
貸倒引当金	△2,367		△2,673			
資産の部合計	6,178,465		6,218,391			
(負債の部)						
預金	2,559,075		2,801,914			
譲渡性預金	702,680		385,550			
コールマネー	908,714		1,008,231			
借入金	300,000		326,100			7-a
外国為替	73		—			
信託勘定借	1,138,586		1,083,338			
その他負債	23,421		38,852			6-f
賞与引当金	1,611		1,648			
変動報酬引当金	123		136			
退職給付引当金	3,508		785			
睡眠預金払戻損失引当金	830		594			
繰延税金負債	21,557		32,288			4-b
支払承諾	13,577		13,909			
負債の部合計	5,673,761		5,693,349			
(純資産の部)						
資本金	247,369		247,369			1-a
資本剰余金	15,505		15,505			1-b
利益剰余金	260,957		256,372			1-c
自己株式	△79,999		△79,999			1-d
株主資本合計	443,832		439,247			
その他有価証券評価差額金	56,325		75,426			
繰延ヘッジ損益	4,546		10,367			5
評価・換算差額等合計	60,871		85,794		(a)	
純資産の部合計	504,704		525,041			
負債及び純資産の部合計	6,178,465		6,218,391			

注) 規制上の連結の範囲と会計上の連結の範囲は同一であります。

みずほ信託銀行単体の自己資本の充実の状況

〈付表〉

1. 株主資本

①中間貸借対照表

(単位：百万円)

参照番号	中間貸借対照表科目	2022年度 中間期	2023年度 中間期	備考
1-a	資本金	247,369	247,369	
1-b	資本剰余金	15,505	15,505	
1-c	利益剰余金	260,957	256,372	
1-d	自己株式	△79,999	△79,999	
	株主資本合計	443,832	439,247	

②自己資本の構成

(単位：百万円)

国際様式の 該当番号	自己資本の構成に関する開示事項	2022年度 中間期	2023年度 中間期	備考
	普通株式等Tier1資本に係る額	443,832	439,247	普通株式に係る株主資本(社外流出予定額調整前)
1a	うち資本金及び資本剰余金の額	262,874	262,874	
2	うち利益剰余金の額	260,957	256,372	
1c	うち自己株式の額(△)	79,999	79,999	
	うち上記以外に該当するものの額	—	—	
31a	その他Tier1資本調達手段に係る額	—	—	

2. 無形固定資産

①中間貸借対照表

(単位：百万円)

参照番号	中間貸借対照表科目	2022年度 中間期	2023年度 中間期	備考
2	無形固定資産	19,636	18,695	
	上記に係る税効果	△5,936	△5,661	

②自己資本の構成

(単位：百万円)

国際様式の 該当番号	自己資本の構成に関する開示事項	2022年度 中間期	2023年度 中間期	備考
8	無形固定資産 のれんに係るもの	249	206	
9	無形固定資産 その他の無形固定資産	13,450	12,828	のれん、モーゲージ・サービシング・ライセンス以外(ソフトウェア等)
	無形固定資産 モーゲージ・サービシング・ライセンス	—	—	
20	特定項目に係る10%基準超過額	—	—	
24	特定項目に係る15%基準超過額	—	—	
74	無形固定資産(モーゲージ・サービシング・ライセンスに係るものに限る。)に係る調整項目不算入額	—	—	

3. 前払年金費用

①中間貸借対照表

(単位：百万円)

参照番号	中間貸借対照表科目	2022年度 中間期	2023年度 中間期	備考
3	前払年金費用	70,107	75,438	
	上記に係る税効果	△21,466	△23,099	

②自己資本の構成

(単位：百万円)

国際様式の 該当番号	自己資本の構成に関する開示事項	2022年度 中間期	2023年度 中間期	備考
15	前払年金費用の額	48,640	52,339	

4. 繰延税金資産

①中間貸借対照表

(単位：百万円)

参照番号	中間貸借対照表科目	2022年度 中間期	2023年度 中間期	備考
	繰延税金資産	—	—	
4-b	繰延税金負債	21,557	32,288	
	無形固定資産の税効果勘案分	5,936	5,661	
	前払年金費用の税効果勘案分	21,466	23,099	

②自己資本の構成

(単位：百万円)

国際様式の 該当番号	自己資本の構成に関する開示事項	2022年度 中間期	2023年度 中間期	備考
10	繰延税金資産(一時差異に係るものを除く。)	—	—	資産負債相殺処理等のため、貸借対照表計上額とは一致せず
	一時差異に係る繰延税金資産	5,845	—	資産負債相殺処理等のため、貸借対照表計上額とは一致せず
21	特定項目に係る10%基準超過額	—	—	
25	特定項目に係る15%基準超過額	—	—	
75	繰延税金資産(一時差異に係るものに限る。)に係る調整項目不算入額	5,845	—	

5. 繰延ヘッジ損益

①中間貸借対照表

(単位：百万円)

参照番号	中間貸借対照表科目	2022年度 中間期	2023年度 中間期	備考
5	繰延ヘッジ損益	4,546	10,367	

②自己資本の構成

(単位：百万円)

国際様式の 該当番号	自己資本の構成に関する開示事項	2022年度 中間期	2023年度 中間期	備考
11	繰延ヘッジ損益の額	4,546	10,367	ヘッジ対象に係る時価評価差額が「評価・換算差額等合計」として計上されているものを除いたもの

みずほ信託銀行単体の自己資本の充実の状況

6. 金融機関向け出資等の対象科目

①中間貸借対照表

(単位：百万円)

参照番号	中間貸借対照表科目	2022年度 中間期	2023年度 中間期	備考
	特定取引資産	—	—	
6-b	有価証券	284,656	277,252	
6-c	貸出金	3,143,912	2,946,923	
6-d	その他資産	258,176	228,315	金融派生商品、出資金等を含む
	特定取引負債	—	—	
6-f	その他負債	23,421	38,852	金融派生商品等を含む

②自己資本の構成

(単位：百万円)

国際様式の 該当番号	自己資本の構成に関する開示事項	2022年度 中間期	2023年度 中間期	備考
	自己保有資本調達手段の額	—	—	
16	普通株式等Tier1相当額	—	—	
37	その他Tier1相当額	—	—	
52	Tier2相当額	—	—	
	意図的に保有している他の金融機関等の資本 調達手段の額	—	—	
17	普通株式等Tier1相当額	—	—	
38	その他Tier1相当額	—	—	
53	Tier2相当額及びその他外部TLAC関連調達 手段の額	—	—	
	少数出資金融機関等の資本調達手段の額	8,013	10,724	
18	普通株式等Tier1相当額	—	—	
39	その他Tier1相当額	—	—	
54	Tier2相当額及びその他外部TLAC関連調達 手段の額	—	—	
72	少数出資金融機関等の対象資本等調達手段に 係る調整項目不算入額	8,013	10,724	
	その他金融機関等(10%超出資)	598	345	
19	特定項目に係る10%基準超過額	—	—	
23	特定項目に係る15%基準超過額	—	—	
40	その他Tier1相当額	—	—	
55	Tier2相当額及びその他外部TLAC関連調達 手段の額	—	—	
73	その他金融機関等に係る対象資本等調達手段 のうち普通株式に係る調整項目不算入額	598	345	

7. その他資本調達

①中間貸借対照表

(単位：百万円)

参照番号	中間貸借対照表科目	2022年度 中間期	2023年度 中間期	備考
7-a	借入金	300,000	326,100	
	社債	—	—	
	合計	300,000	326,100	

②自己資本の構成

(単位：百万円)

国際様式の 該当番号	自己資本の構成に関する開示事項	2022年度 中間期	2023年度 中間期	備考
32	その他Tier1資本調達手段に係る負債の額	—	—	
46	Tier2資本調達手段に係る負債の額	—	—	

■リスク・アセットの概要

(A) OV1：リスク・アセットの概要

(単位：百万円)

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			
		2023年度中間期	2022年度中間期	2023年度中間期	2022年度中間期	2023年度中間期	2022年度中間期	2023年度中間期	2022年度中間期
1	信用リスク	1,133,144	1,164,064	95,245	98,052				
2	うち、標準的手法適用分	—	—	—	—				
3	うち、内部格付手法適用分	957,036	1,026,553	81,156	87,051				
	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	176,107	137,510	14,088	11,000				
4	カウンターパーティ信用リスク	6,285	3,743	529	313				
5	うち、SA-CCR適用分	—	—	—	—				
	うち、カレント・エクスポージャー方式適用分	—	—	—	—				
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	—	—	—	—				
	うち、CVAリスク	—	—	—	—				
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	705	845	56	67				
	その他	5,580	2,897	473	245				
7	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	117,973	128,582	10,004	10,903				
8	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)	43,543	36,177	3,628	3,016				
9	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%)	—	—	—	—				
	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%)	—	—	—	—				
10	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%)	13	9	1	0				
11	未決済取引	—	—	—	—				
12	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	2,302	659	184	52				
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	2,302	659	184	52				
14	うち、外部格付準拠方式適用分	—	—	—	—				
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	—	—	—	—				
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	—	—	—	—				
16	マーケット・リスク	140	135	11	10				
17	うち、標準的方式適用分	140	135	11	10				
18	うち、内部モデル方式適用分	—	—	—	—				
19	オペレーショナル・リスク	268,504	266,119	21,480	21,289				
20	うち、基礎的手法適用分	—	—	—	—				
21	うち、粗利益配分手法適用分	—	—	—	—				
22	うち、先進的計測手法適用分	268,504	266,119	21,480	21,289				
23	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	863	16,108	73	1,295				
	経過措置によりリスク・アセットの額に算入されるものの額	—	—	—	—				
24	フロア調整	—	12,028	—	962				
25	合計(スケーリング・ファクター勘案後)	1,639,465	1,698,733	131,157	135,898				

みずほ信託銀行単体の自己資本の充実の状況

■マーケット・リスク

(1) バンキング業務

(A) IRRBB1:金利リスク

(単位：百万円)

項番		イ		ロ		ハ		ニ	
		ΔEVE				ΔNII			
		2023年度中間期		2022年度中間期		2023年度中間期		2022年度中間期	
1	上方パラレルシフト	0	3,445			△21,789	△20,922		
2	下方パラレルシフト	3,609	1			20,242	19,577		
3	スティープ化	1,698	3,701			/	/		
4	フラット化	0	27			/	/		
5	短期金利上昇	0	35			/	/		
6	短期金利低下	2,522	1,483			/	/		
7	最大値	3,609	3,701			20,242	19,577		
		ホ				へ			
		2023年度中間期				2022年度中間期			
8	Tier1資本の額	447,032				436,362			

- 注) 1. 経済的価値・金利収益が減少する方向をプラスで表記しています。
 2. 明確な金利改定間隔がなく、預金者の要求によって随時払い出される当座預金や普通預金等の一部では、コア預金として認識の上、適切な方法により計測を行っています。金利改定の平均満期は、円預金0.3年となります。最長の金利改定満期は、円預金4.5年となります。また、定期預金や貸出等は、返済・解約実績等を踏まえ期限前解約率を推定し、適切な方法により計測を行っています。
 3. ΔEVE及びΔNIIともに計測対象はJPYのみとなります。JPY以外の金利リスクについては僅少であり、複数通貨の集計はしていません。
 4. ΔEVE、ΔNIIの計測にあたり、割引金利や参照金利に応じて適切な金利やスプレッドを設定しています。
 5. 算出にあたり、規制で定められた金利ショック等の前提を用いています。

■単体レバレッジ比率の構成に関する事項

(1) レバレッジ比率の構成に関する事項

(単位：百万円、%)

国際様式(表2) の該当番号	国際様式(表1) の該当番号	項目	2022年度中間期	2023年度中間期
1. オン・バランス資産の額				
1		調整項目控除前のオン・バランス資産の額	3,939,187	3,690,224
1a	1	貸借対照表における総資産の額	3,993,333	3,778,877
1b	3	貸借対照表における総資産の額から控除される調整項目以外の資産の額(△)	54,146	88,652
2	7	Tier1 資本に係る調整項目の額(△)	63,795	67,640
3		オン・バランス資産の額 (イ)	3,875,392	3,622,584
2. デリバティブ取引等に関する額				
4		デリバティブ取引等に関するRCの額に1.4を乗じた額	—	—
		デリバティブ取引等に関する再構築コストの額	13,982	21,676
5		デリバティブ取引等に関するPFEの額に1.4を乗じた額	—	—
		デリバティブ取引等に関するアドオンの額	13,310	13,588
		デリバティブ取引等に関連して現金で差し入れた証拠金の対価の額	846	—
6		貸借対照表から控除されているデリバティブ取引等に関連して差し入れた担保の対価の額	—	—
		貸借対照表から控除されているデリバティブ取引等に関連して現金で差し入れた証拠金の対価の額	—	—
7		デリバティブ取引等に関連して現金で差し入れた変動証拠金の対価の額のうち控除する額(△)	—	—
8		清算会員である銀行が補償を義務付けられていない顧客とのトレード・エクスポージャーの額(△)	/	/
9		クレジット・デリバティブのプロテクションを提供した場合における調整後想定元本の額	—	—
10		クレジット・デリバティブのプロテクションを提供した場合における調整後想定元本の額から控除した額(△)	—	—
11	4	デリバティブ取引等に関する額 (ロ)	28,140	35,264
3. レボ取引等に関する額				
12		レボ取引等に関する資産の額	20,038	40,318
13		レボ取引等に関する資産の額から控除した額(△)	—	—
14		レボ取引等に関するカウンターパーティ・リスクのエクスポージャーの額	20,038	40,318
15		代理取引のエクスポージャーの額	/	/
16	5	レボ取引等に関する額 (ハ)	40,077	80,636
4. オフ・バランス取引に関する額				
17		オフ・バランス取引の想定元本の額	483,520	481,916
18		オフ・バランス取引に係るエクスポージャーの額への変換調整の額(△)	260,887	252,269
19	6	オフ・バランス取引に関する額 (ニ)	222,633	229,647
5. 単体レバレッジ比率				
20		資本の額 (ホ)	436,362	447,032
21	8	総エクスポージャーの額((イ)+(ロ)+(ハ)+(ニ)) (ヘ)	4,166,243	3,968,132
22		単体レバレッジ比率((ホ)/(ヘ))	10.47%	11.26%
		適用する所要単体レバレッジ比率	/	3.00%
6. 日本銀行に対する預け金を算入する場合の単体レバレッジ比率				
		総エクスポージャーの額 (ヘ)	4,166,243	3,968,132
		日本銀行に対する預け金の額	2,185,131	2,439,513
		日本銀行に対する預け金を算入する場合の総エクスポージャーの額 (ヘ')	6,351,374	6,407,646
		日本銀行に対する預け金を算入する場合の単体レバレッジ比率((ホ)/(ヘ'))	6.87%	6.97%

注) 当行は、単体レバレッジ比率の算定に関する外部監査として、日本公認会計士協会専門業務実務指針4465「自己資本比率及びレバレッジ比率の算定に対する合意された手続業務に関する実務指針」に基づく合意された手続業務を、EY新日本有限責任監査法人により受けています。なお、当該業務は、財務諸表の監査又は財務報告に係る内部統制の監査の一部ではありません。当該業務は、レバレッジ比率そのものやレバレッジ比率の算定に係る内部管理体制について意見又は結論を表明するものではなく、当行と合意した範囲において手続をEY新日本有限責任監査法人が実施し、当行に対しその結果を報告するものです。

前中間会計年度の単体レバレッジ比率との間に著しい差異を生じた原因

貸出金の減少等により、総エクスポージャーが減少したものの。

みずほ信託銀行単体の流動性に係る経営の健全性の状況

「銀行法施行規則第19条の2第1項第5号ホ等の規定に基づき、経営の健全性の状況について金融庁長官が別に定める事項のうち、流動

性に係る健全性を判断するための基準に係る事項」(平成27年金融庁告示第7号)に基づき、開示しています。

■流動性カバレッジ比率

(1) 単体流動性カバレッジ比率に関する定量的開示事項

(単位：百万円、%、件)

項目	2023年度第1四半期		2023年度第2四半期	
適格流動資産 (1)	/		/	
1 適格流動資産の合計額	2,835,989		2,591,104	
資金流出額 (2)	資金流出率を乗じる前の額	資金流出率を乗じた後の額	資金流出率を乗じる前の額	資金流出率を乗じた後の額
2 リテール無担保資金調達に係る資金流出額	1,533,522	135,354	1,521,528	134,387
3 うち、安定預金の額	258,432	7,752	254,983	7,649
4 うち、準安定預金の額	1,275,089	127,601	1,266,545	126,738
5 ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,980,534	1,663,791	1,981,183	1,700,317
6 うち、適格オペレーショナル預金の額	—	—	—	—
7 うち、適格オペレーショナル預金及び負債性有価証券以外のホールセール無担保資金調達に係る資金の額	1,922,359	1,605,615	1,883,637	1,602,772
8 うち、負債性有価証券の額	58,175	58,175	97,545	97,545
9 有担保資金調達等に係る資金流出額	/	—	/	—
10 デリバティブ取引等、資金調達プログラム及び与信・流動性ファシリティに係る資金流出額	409,639	94,455	403,376	90,667
11 うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	20,037	20,037	20,044	20,044
12 うち、資金調達プログラムに係る資金流出額	—	—	—	—
13 うち、与信・流動性ファシリティに係る資金流出額	389,602	74,418	383,332	70,623
14 資金提供義務に基づく資金流出額等	12,679	10,236	1,041	1,018
15 偶発事象に係る資金流出額	1,009,410	1,635	1,041,790	1,583
16 資金流出合計額	/	1,905,473	/	1,927,974
資金流入額 (3)	資金流入率を乗じる前の額	資金流入率を乗じた後の額	資金流入率を乗じる前の額	資金流入率を乗じた後の額
17 有担保資金運用等に係る資金流入額	90,101	—	16,795	—
18 貸付金等の回収に係る資金流入額	189,361	127,669	198,613	130,898
19 その他資金流入額	19,070	18,968	3,500	3,463
20 資金流入合計額	298,533	146,638	218,909	134,361
単体流動性カバレッジ比率 (4)	/	/	/	/
21 算入可能適格流動資産の合計額	/	2,835,989	/	2,591,104
22 純資金流出額	/	1,758,834	/	1,793,613
23 単体流動性カバレッジ比率	/	162.2%	/	145.3%
24 平均値計算用データ数	62		62	

(2) 単体流動性カバレッジ比率に関する定性的開示事項

(A) 時系列における単体流動性カバレッジ比率の変動に関する事項

当行の単体LCRIは、過去2年間安定的に推移しています。

(B) 単体流動性カバレッジ比率の水準の評価に関する事項

当行の単体LCRIは、規制水準(100%)を上回っており、特段の問題はないものと評価しています。

なお、今後の単体LCRの見通しが開示された比率と大きく乖離することは想定していません。

また、単体LCRの実績値は当初の見通しと大きく異なっていません。

(C) 算入可能適格流動資産の合計額の内容に関する事項

算入可能適格流動資産の通貨又は種類等の構成や所在地に著しい変動はありません。

なお、主要な通貨(通貨建て負債合計額が当行の負債合計額の5%以上を占める通貨)において、算入可能適格流動資産の合計額と純資金流出額の間に、著しい通貨のミスマッチはありません。

(D) その他単体流動性カバレッジ比率に関する事項

当行の単体LCRIは、告示第60号第29条の「適格オペレーショナル預金に係る特例」及び同告示第60号第38条の「シナリオ法による時価変動時所要追加担保額」を適用していません。

なお、告示第60号第60条の「その他契約に基づく資金流出額」、告示第60号第53条の「その他偶発事象に係る資金流出額」、告示第60号第73条の「その他契約に基づく資金流入額」について開示が必要となる重要な項目はありません。

単体LCRIに与える影響に鑑み、重要性が乏しい項目等については、日次データを使用していない場合があります。

■安定調達比率

(1) 単体安定調達比率に関する定量的開示事項

(単位：百万円、%)

項番		2023年度第1四半期					2023年度第2四半期				
		算入率考慮前金額				算入率考慮後金額	算入率考慮前金額				算入率考慮後金額
		満期なし	6月末満	6月以上1年未満	1年以上		満期なし	6月末満	6月以上1年未満	1年以上	
利用可能安定調達額 (1)											
1	資本の額	507,829	—	—	—	507,829	525,179	—	—	—	525,179
2	うち、普通株式等Tier1資本、その他Tier1資本及びTier2資本(基準日から1年を経過する前に弁済期が到来するものを除く。)に係る基礎項目の額	507,829	—	—	—	507,829	525,179	—	—	—	525,179
3	うち、上記に含まれない資本調達手段及び資本の額	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
4	個人及び中小企業等からの資金調達	1,525,494	—	—	—	1,385,751	1,513,704	—	—	—	1,375,044
5	うち、安定預金等の額	256,126	—	—	—	243,319	254,210	—	—	—	241,499
6	うち、準安定預金等の額	1,269,367	—	—	—	1,142,431	1,259,494	—	—	—	1,133,544
7	ホールセール資金調達	582,135	2,586,843	618,611	671,631	1,683,779	563,447	2,370,211	600,147	605,055	1,523,357
8	うち、適格オペレーショナル預金の額	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
9	うち、その他のホールセール資金調達の額	582,135	2,586,843	618,611	671,631	1,683,779	563,447	2,370,211	600,147	605,055	1,523,357
10	相互に関係する資産がある負債	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
11	その他の負債	61,064	—	—	—	21,511	56,868	—	—	—	21,566
12	うち、デリバティブ負債の額	/	/	/	—	/	/	/	/	—	/
13	うち、上記に含まれない負債の額	61,064	—	—	—	21,511	56,868	—	—	—	21,566
14	利用可能安定調達額合計	/	/	/	/	3,598,870	/	/	/	/	3,445,147
所要安定調達額 (2)											
15	流動資産の額	/	/	/	/	66,228	/	/	/	/	67,470
16	金融機関等に預け入れているオペレーショナル預金に相当するものの額	6,164	—	—	—	3,082	6,336	—	—	—	3,168
17	貸出金又はレボ形式の取引による資産及び有価証券その他これに類するものの額	156,045	695,543	265,210	2,454,226	2,588,724	129,348	490,676	186,431	2,434,611	2,430,261
18	うち、レベル1資産を担保とする金融機関等への貸出金及びレボ形式の取引による額	—	280,318	—	—	130,104	—	40,318	—	—	—
19	うち、項番18に含まれない金融機関等への貸出金及びレボ形式の取引による額	126,156	116,018	39,326	321,415	377,405	87,284	108,322	22,820	341,450	382,201
20	うち、貸出金又はレボ形式の取引による資産の額(項番18、19及び22に該当する額を除く。)	299	297,993	189,835	2,043,397	1,965,143	304	340,866	127,609	2,006,095	1,923,555
21	うち、リスク・ウェイトが35%以下の資産の額	—	1,355	2,316	80,993	54,482	—	2,496	436	82,019	54,779
22	うち、住宅ローン債権	—	1,014	998	19,869	14,186	—	998	975	19,222	13,742
23	うち、リスク・ウェイトが35%以下の資産の額	—	934	919	18,545	12,981	—	919	898	17,921	12,557
24	うち、流動資産に該当しない有価証券その他これに類するもの	29,588	197	35,048	69,544	101,886	41,760	171	35,025	67,842	110,761
25	相互に関係する負債がある資産	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
26	その他の資産等	381,252	1,601	566	33,568	414,512	388,957	886	469	16,700	406,895
27	うち、現物決済されるコモディティ(金を含む。)	—	/	/	/	—	—	/	/	/	—
28	うち、デリバティブ取引等又は中央清算機関との取引に関連して預託した当初証拠金又は清算基金(連結貸借対照表に計上されないものを含む。)	/	/	/	16,500	14,025	/	/	/	—	—
29	うち、デリバティブ資産の額	/	/	/	803	803	/	/	/	511	511
30	うち、デリバティブ負債(変動証拠金の対価の額を減する前)の額	/	/	/	—	—	/	/	/	—	—
31	うち、上記に含まれない資産及び資本の額	381,252	1,601	566	16,265	399,684	388,957	886	469	16,188	406,383
32	オフ・バランス取引	/	/	/	1,424,143	21,008	/	/	/	1,404,407	20,590
33	所要安定調達額合計	/	/	/	/	3,093,557	/	/	/	/	2,928,385
34	単体安定調達比率	/	/	/	/	116.3%	/	/	/	/	117.6%

みずほ信託銀行単体の流動性に係る経営の健全性の状況

(2) 単体安定調達比率に関する定性的開示事項

(A) 時系列における単体安定調達比率の変動に関する事項

当行の単体NSFRは、2021年9月末の規制適用以降、安定的に推移しています。

(B) 相互に関係する資産・負債の特例に関する事項

当行の単体NSFRは、告示第60号第101条に定める「相互に関係する資産・負債の特例」を適用していません。

(C) その他単体安定調達比率に関する事項

当行の単体NSFRは、規制水準(100%)を上回っており、特段の問題はないものと評価しています。

なお、今後の単体NSFRの見通しが開示された比率と大きく乖離することは想定していません。

また、単体NSFRの実績値は当初の見通しと大きく異なっておりません。