

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
		2024年度 第2四半期末	2024年度 第1四半期末	2023年度 第4四半期末	2023年度 第3四半期末	2023年度 第2四半期末
資本						
1	普通株式等Tier 1 資本の額	488,854	477,429	476,609	483,526	471,507
2	Tier 1 資本の額	488,870	477,432	476,624	483,542	471,524
3	総自己資本の額	489,054	477,592	476,729	483,662	471,676
リスク・アセット						
4	リスク・アセットの額	1,541,322	1,594,476	1,644,448	1,638,890	1,659,176
4a	リスク・アセットの額（フロア調整前）	1,541,322	1,594,476	1,644,448	／	／
	リスク・アセットの額（フロア調整最終実施ベース）	1,891,520	1,971,006	2,039,354	／	／
自己資本比率						
5	連結普通株式等Tier 1 比率	31.71%	29.94%	28.98%	29.50%	28.41%
5a	連結普通株式等Tier1比率（フロア調整前）	31.71%	29.94%	28.98%	／	／
	連結普通株式等Tier1比率（フロア調整最終実施ベース）	25.84%	24.22%	23.37%	／	／
6	連結Tier 1 比率	31.71%	29.94%	28.98%	29.50%	28.41%
6a	連結Tier1比率（フロア調整前）	31.71%	29.94%	28.98%	／	／
	連結Tier1比率（フロア調整最終実施ベース）	25.84%	24.22%	23.37%	／	／
7	連結総自己資本比率	31.72%	29.95%	28.99%	29.51%	28.42%
7a	連結総自己資本比率（フロア調整前）	31.72%	29.95%	28.99%	／	／
	連結総自己資本比率（フロア調整最終実施ベース）	25.85%	24.23%	23.37%	／	／
連結レバレッジ比率						
13	総エクスポージャーの額	3,863,339	4,129,208	4,100,351	4,143,089	4,070,999
14	連結レバレッジ比率	12.65%	11.56%	11.62%	11.67%	11.58%
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	1,853,752	1,468,339	2,517,145	2,519,163	2,668,457
16	純資金流出額	963,185	884,073	1,734,750	1,904,192	1,882,992
17	連結流動性カバレッジ比率	192.9%	168.0%	148.3%	132.7%	142.5%
連結安定調達比率						
18	利用可能安定調達額	3,515,644	3,361,174	3,423,833	3,438,467	3,508,947
19	所要安定調達額	2,801,739	3,000,483	2,943,018	2,931,331	2,987,921
20	連結安定調達比率	125.4%	112.0%	116.3%	117.3%	117.4%

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

2023年度中間期、2024年度中間期とも、該当ありません。

(B) 連結子会社の数

	2023年度中間期	2024年度中間期
連結子会社	10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

2023年度中間期、2024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

2023年度中間期、2024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

2023年度中間期、2024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

2023年度中間期、2024年度中間期とも、該当ありません。

■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 2023年度 中間期	ロ 2024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	469,534	487,787	
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	284,339	302,591	
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	普通株式に係る株式引受権及び新株予約権の合計額	—	—	
3	その他の包括利益累計額及びその他公表準備金の額	128,205	134,956	(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)	597,740	622,743	
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	24,696	23,804	
8	うちのれんに係るもの(のれん相当差額を含む。)の額	10,294	9,427	
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	14,402	14,377	
10	繰延税金資産(一時差異に係るものを除く。)の額	2	7	
11	繰延ヘッジ損益の額	10,367	6,028	
12	適格引当金不足額	2,259	4,260	
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	88,906	99,787	
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連するものの額	—	—	
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連するものの額	—	—	
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)	126,233	133,889	
普通株式等Tier1資本				
29	普通株式等Tier1資本の額((イ)-(ロ)) (ハ)	471,507	488,854	

(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 2023年度 中間期	ロ 2024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株式引受権及び新株予約権の合計額	—	—	
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	その他Tier1資本に係る調整後非支配株主持分等の額	17	16	
36	その他Tier1資本に係る基礎項目の額 (二)	17	16	
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)	17	16	
Tier1資本				
45	Tier1資本の額((ハ)＋(ヘ)) (ト)	471,524	488,870	
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株式引受権及び新株予約権の合計額	—	—	
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	Tier2資本に係る調整後非支配株主持分等の額	4	3	
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	148	180	
50a	うち一般貸倒引当金Tier2算入額	148	180	
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)	152	184	

(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 2023年度 中間期	ロ 2024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)	152	184	
総自己資本				
59	総自己資本の額((ト)＋(ヌ)) (ル)	471,676	489,054	
リスク・アセット (6)				
60	リスク・アセットの額 (ヲ)	1,659,176	1,541,322	
連結自己資本比率 (7)				
61	連結普通株式等Tier1比率((ハ)／(ヲ))	28.41%	31.71%	
62	連結Tier1比率((ト)／(ヲ))	28.41%	31.71%	
63	連結総自己資本比率((ル)／(ヲ))	28.42%	31.72%	
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	10,724	9,693	
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	1,644	4,033	
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	929	1,136	
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	148	180	
77	一般貸倒引当金に係るTier2資本算入上限額	1,355	1,007	
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	7,345	6,760	

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います。

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。

みずほ信託銀行連結の自己資本の充実の状況

(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

項目	(単位：百万円)		ハ 別紙様式第五号を参照 する番号又は記号	ニ 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 2023年度中間期	ロ 公表 中間連結貸借対照表 2024年度中間期		
(資産の部)				
現金預け金	2,576,430	1,783,884		
債券貸借取引支払保証金	40,318	104,950		
買入金銭債権	39,541	15,403		
金銭の信託	26,001	28,198		
有価証券	282,719	285,998		2-b, 6-b
貸出金	2,936,138	2,740,864		6-c
外国為替	5,472	8,760		
その他資産	239,116	149,198		6-d
有形固定資産	93,485	92,008		
無形固定資産	30,500	29,582		2-a
退職給付に係る資産	128,144	143,828		3
繰延税金資産	766	935		4-a
支払承諾見返	13,909	9,335		
貸倒引当金	△2,734	△5,110		
資産の部合計	6,409,811	5,387,837		
(負債の部)				
預金	2,895,583	2,741,668		
譲渡性預金	385,550	358,880		
コールマネー及び売渡手形	1,008,231	7,766		
借入金	326,100	501,500		8-a
信託勘定借	1,083,338	1,033,963		
その他負債	45,365	50,613		6-f
賞与引当金	3,218	7,139		
変動報酬引当金	136	172		
退職給付に係る負債	1,124	1,153		
役員退職慰労引当金	169	186		
偶発損失引当金	—	50		
睡眠預金払戻損失引当金	594	423		
繰延税金負債	48,643	52,103		4-b
支払承諾	13,909	9,335		
負債の部合計	5,811,966	4,764,956		
(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	284,339	302,591		1-c
自己株式	△79,999	△79,999		1-d
株主資本合計	469,534	487,787		
その他有価証券評価差額金	75,875	81,046		
繰延ヘッジ損益	10,367	6,028		5
為替換算調整勘定	4,849	6,855		
退職給付に係る調整累計額	37,112	41,025		
その他の包括利益累計額合計	128,205	134,956	(a)	
非支配株主持分	104	137		7
純資産の部合計	597,844	622,881		
負債及び純資産の部合計	6,409,811	5,387,837		

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。

〈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	2023年度 中間期	2024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	284,339	302,591	
1-d	自己株式	△79,999	△79,999	
	株主資本合計	469,534	487,787	

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	2023年度 中間期	2024年度 中間期	備考
	普通株式等Tier1資本に係る額	469,534	487,787	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	284,339	302,591	
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	2023年度 中間期	2024年度 中間期	備考
2-a	無形固定資産	30,500	29,582	
2-b	有価証券	282,719	285,998	
	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	△5,803	△5,777	

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	2023年度 中間期	2024年度 中間期	備考
8	無形固定資産 のれんに係るもの	10,294	9,427	
9	無形固定資産 その他の無形固定資産	14,402	14,377	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り。)に係る調整項目不算入額	—	—	

みずほ信託銀行連結の自己資本の充実の状況

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	2023年度 中間期	2024年度 中間期	備考
3	退職給付に係る資産	128,144	143,828	
	上記に係る税効果	△39,237	△44,040	

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	2023年度 中間期	2024年度 中間期	備考
15	退職給付に係る資産の額	88,906	99,787	

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	2023年度 中間期	2024年度 中間期	備考
4-a	繰延税金資産	766	935	
4-b	繰延税金負債	48,643	52,103	
	無形固定資産の税効果勘案分	5,803	5,777	
	退職給付に係る資産の税効果勘案分	39,237	44,040	

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	2023年度 中間期	2024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。)	2	7	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	929	1,136	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	929	1,136	

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	2023年度 中間期	2024年度 中間期	備考
5	繰延ヘッジ損益	10,367	6,028	

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	2023年度 中間期	2024年度 中間期	備考
11	繰延ヘッジ損益の額	10,367	6,028	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

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	2023年度 中間期	2024年度 中間期	備考
	特定取引資産	—	—	
6-b	有価証券	282,719	285,998	
6-c	貸出金	2,936,138	2,740,864	
6-d	その他資産	239,116	149,198	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	45,365	50,613	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	2023年度 中間期	2024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	10,724	9,693	
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	10,724	9,693	
	その他金融機関等(10%超出資)	1,644	4,033	
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	1,644	4,033	

みずほ信託銀行連結の自己資本の充実の状況

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	2023年度 中間期	2024年度 中間期	備考
7	非支配株主持分	104	137	

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	2023年度 中間期	2024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	17	16	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	4	3	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	2023年度 中間期	2024年度 中間期	備考
8-a	借入金	326,100	501,500	
	社債	—	—	
	合計	326,100	501,500	

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	2023年度 中間期	2024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	
		リスク・アセット		所要自己資本	
		2023年度中間期		2023年度中間期	
1	信用リスク	1,072,747		89,988	
2	うち、標準的手法適用分	20,705		1,656	
3	うち、内部格付手法適用分	868,387		73,639	
	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		14,692	
4	カウンターパーティ信用リスク	722		57	
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		56	
	その他	17		1	
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		11,782	
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		3,628	
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		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		238	
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		184	
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		184	
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		86	
17	うち、標準的方式適用分	1,081		86	
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		25,978	
20	うち、基礎的手法適用分	56,226		4,498	
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		21,480	
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		534	
	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		132,734	

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)

国際様式の 概要番号		イ		ロ	
		リスク・アセット		所要自己資本	
		2024年度中間期		2024年度中間期	
1	信用リスク	1,086,619		86,929	
2	うち、標準的手法適用分	178,779		14,302	
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	439,610		35,168	
4	うち、スロットティング・クライテリア適用分	—		—	
5	うち、先進的内部格付手法適用分	324,945		25,995	
	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	143,284		11,462	
6	カウンターパーティ信用リスク	1,241		99	
7	うち、SA-CCR適用分	—		—	
8	うち、期待エクスポージャー方式適用分	—		—	
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	562		44	
9	その他	679		54	
10	CVAリスク	—		—	
	うち、SA-CVA適用分	—		—	
	うち、完全なBA-CVA適用分	—		—	
	うち、限定的なBA-CVA適用分	—		—	
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	161,016		12,881	
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)	35,619		2,849	
13	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算(マンドート方式)	—		—	
	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算(蓋然性方式250%)	2,422		193	
	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算(蓋然性方式400%)	—		—	
14	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算(フォールバック方式1250%)	1,575		126	
15	未決済取引	—		—	
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	3,197		255	
17	うち、内部格付手法準拠方式適用分	3,197		255	
18	うち、外部格付準拠方式又は内部評価方式適用分	—		—	
19	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	—		—	
20	マーケット・リスク	22,034		1,762	
21	うち、標準的方式適用分	—		—	
22	うち、内部モデル方式適用分	—		—	
	うち、簡易的方式適用分	22,034		1,762	
23	勘定間の振替分	—		—	
24	オペレーショナル・リスク	214,670		17,173	
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	12,925		1,034	
26	フロア調整	—		—	
27	合計	1,541,322		123,305	

注) 株式等エクスポージャーにおいて、内部格付手法で計測される場合に適用されるリスク・ウェイトと、標準的手法で計測される場合に適用されるリスク・ウェイトが同値の場合については、標準的手法を適用しているものとみなします。

■内部モデルを用いた手法と標準的手法の比較

(A) CMS2：ポートフォリオ別の内部格付手法と標準的手法の信用リスク・アセットの比較

(単位：百万円)

項番		2024年度中間期			
		イ	ロ	ハ	ニ
		信用リスク・アセットの額			
		内部格付手法適用分の信用リスク・アセットの額	イ欄の内部格付手法適用分の信用リスク・アセットの額について、標準的手法により算出した信用リスク・アセットの額	信用リスク・アセットの額	資本フロア計算に用いられる、標準的手法により算出した信用リスク・アセットの額(フロア掛目前)
1	ソブリン向けエクスポージャー	1,085	1,353	1,085	1,353
	うち、我が国の地方公共団体向け	—	—	—	—
	うち、外国の中央政府等以外の公共部門向け	—	—	—	—
	うち、国際開発銀行向け	—	—	—	—
	うち、地方公共団体金融機構向け	80	150	80	150
	うち、我が国の政府関係機関向け	975	1,191	975	1,191
	うち、地方三公社向け	29	11	29	11
2	金融機関等向けエクスポージャー	36,479	35,505	65,877	64,903
3	株式等向けエクスポージャー	36,497	22,222	184,823	170,548
4	購入債権	1,083	1,581	1,083	1,581
5	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。）	492,118	1,017,489	493,174	1,018,545
	うち、基礎的内部格付手法適用分	402,046		402,046	
	うち、先進的内部格付手法適用分	90,071		90,071	
6	中堅中小企業向けエクスポージャー	48,210	121,680	48,210	121,680
	うち、基礎的内部格付手法適用分	—		—	
	うち、先進的内部格付手法適用分	48,210		48,210	
7	居住用不動産向けエクスポージャー	17,371	12,785	17,371	12,785
8	適格リボルビング型リテール向けエクスポージャー	—	—	—	—
9	その他リテール向けエクスポージャー	25,597	79,005	25,597	79,005
10	特定貸付債権	106,110	444,642	106,110	444,642
	うち、事業用不動産向け貸付け及びボラティリティの高い事業用不動産向け貸付け	103,377	440,132	103,377	440,132
11	合計	764,555	1,736,265	943,335	1,915,045

注) 株式等エクスポージャーにおいて、内部格付手法で計測される場合に適用されるリスク・ウェイトと、標準的手法で計測される場合に適用されるリスク・ウェイトが同値の場合については、標準的手法を適用しているものとみなします。

みずほ信託銀行連結の自己資本の充実の状況

■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	2023年度中間期			
	イ	ロ	ハ	ニ
	帳簿価額の総額 デフォルトした エクスポージャー	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。

(単位：百万円)

項 番	2024年度中間期			
	イ	ロ	ハ	ニ
	帳簿価額の総額 デフォルトした エクスポージャー	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	26,202	2,714,325	4,867	2,735,660
2 有価証券(うち負債性のもの)	—	91,094	—	91,094
3 その他オン・バランスシートの資産(うち負債性のもの)	—	1,803,947	79	1,803,868
4 オン・バランスシートの資産の合計 (1+2+3)	26,202	4,609,367	4,946	4,630,622
オフ・バランスシートの資産				
5 支払承諾等	—	9,335	14	9,321
6 コミットメント等	80	336,578	—	336,658
7 オフ・バランスシートの資産の合計 (5+6)	80	345,914	14	345,980
合計				
8 合計 (4+7)	26,282	4,955,281	4,961	4,976,602

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。

(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)

		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
3		335
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	非デフォルト状態へ復帰した額
5		1,145
6		償却された額
7		—
8		その他の変動額
9		△2,143
10	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。

(単位：百万円)

		2024年度中間期
項 番		額
1	2023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	25,422
2		デフォルトした額
3		2,200
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	非デフォルト状態へ復帰した額
5		140
6		償却された額
7		—
8		その他の変動額
9		△1,280
10	2024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)	26,202

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)

2023年度中間期													
項番	PD 区分	イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ	ト	チ	リ	ヌ	ル	ラ
		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)

		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
項番	PD 区分												
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. 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。

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(先進的内部格付手法適用分) (単位：百万円、%、千件、年)

項番		2024年度中間期											
		イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ	ト	チ	リ	ヌ	ル	ラ
		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
PD 区分													
ソブリン向けエクスポージャー													
1	0.00以上0.15未満	1,619,679	15,007	10.00	1,621,180	0.00	0.0	36.78	0.2	1,060	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	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	／
7	10.00以上100.00未満	12	6	40.00	15	12.95	0.0	36.78	1.5	25	164.60	0	／
8	100.00(デフォルト)	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	／
9	小計	1,619,692	15,013	10.01	1,621,195	0.00	0.0	36.78	0.2	1,085	0.06	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	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	／
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	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
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	290,084	16,661	58.33	299,803	0.06	0.0	36.46	3.2	66,184	22.07	69	／
2	0.15以上0.25未満	6,758	193	24.46	6,805	0.18	0.0	33.81	2.4	2,089	30.70	4	／
3	0.25以上0.50未満	11,159	2,971	53.69	12,755	0.41	0.0	25.19	3.1	4,970	38.96	13	／
4	0.50以上0.75未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	／
5	0.75以上2.50未満	22,440	687	93.45	23,083	1.16	0.0	19.77	3.6	10,264	44.46	53	／
6	2.50以上10.00未満	6,173	815	37.43	6,478	2.85	0.0	16.44	4.3	3,437	53.05	31	／
7	10.00以上100.00未満	2,041	—	—	2,041	12.95	0.0	30.20	3.0	2,983	146.15	79	／
8	100.00(デフォルト)	1,129	—	—	1,129	100.00	0.0	24.48	1.1	141	12.54	276	／
9	小計	339,788	21,328	57.71	352,097	0.59	0.2	34.46	3.2	90,071	25.58	529	295
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	8,117	1,300	10.00	8,247	0.13	0.0	36.01	2.2	1,999	24.24	3	／
2	0.15以上0.25未満	13,182	290	10.00	13,211	0.18	0.0	17.09	3.9	2,010	15.21	4	／
3	0.25以上0.50未満	24,757	1,612	98.74	26,349	0.41	0.1	13.07	4.5	4,997	18.96	14	／
4	0.50以上0.75未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	／
5	0.75以上2.50未満	92,812	3,391	74.24	95,329	1.00	0.3	13.94	4.6	26,383	27.67	137	／
6	2.50以上10.00未満	37,661	648	10.00	37,726	2.71	0.1	11.55	4.9	11,499	30.48	118	／
7	10.00以上100.00未満	2,681	—	—	2,681	12.95	0.0	12.03	4.7	1,319	49.21	41	／
8	100.00(デフォルト)	102	—	—	102	100.00	0.0	10.00	1.0	—	—	10	／
9	小計	179,315	7,241	59.84	183,649	1.40	0.7	14.51	4.5	48,210	26.25	329	184
特定貸付債権													
1	0.00以上0.15未満	514,863	170	40.00	514,932	0.06	0.1	29.41	3.6	95,105	18.46	92	／
2	0.15以上0.25未満	11,366	383	40.00	11,519	0.18	0.0	27.87	4.9	4,602	39.95	6	／
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	7,193	—	—	7,193	0.97	0.0	28.42	3.6	4,723	65.66	19	／
6	2.50以上10.00未満	1,285	41	10.00	1,290	2.70	0.0	36.78	5.0	1,644	127.50	12	／
7	10.00以上100.00未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	／
8	100.00(デフォルト)	480	—	—	480	100.00	0.0	80.23	2.0	34	7.25	385	／
9	小計	535,190	595	37.90	535,416	0.17	0.1	29.43	3.6	106,110	19.81	516	288
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	11,977	—	—	11,977	0.13	0.0	90.00	5.0	13,618	113.70	／	／
2	0.15以上0.25未満	4,356	—	—	4,356	0.18	0.0	90.00	5.0	5,785	132.79	／	／
3	0.25以上0.50未満	2,808	—	—	2,808	0.41	0.0	90.00	5.0	5,271	187.66	／	／
4	0.50以上0.75未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	／	／
5	0.75以上2.50未満	1,777	—	—	1,777	1.38	0.0	90.00	5.0	4,936	277.67	／	／
6	2.50以上10.00未満	903	—	—	903	3.88	0.0	90.00	5.0	3,562	394.26	／	／
7	10.00以上100.00未満	230	—	—	230	12.95	0.0	90.00	5.0	1,442	625.09	／	／
8	100.00(デフォルト)	167	—	—	167	100.00	0.0	90.00	5.0	1,880	1,125.00	／	／
9	小計	22,222	—	—	22,222	1.31	0.2	90.00	5.0	36,497	164.23	／	／

(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		2024年度中間期											
		イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ	ト	チ	リ	ヌ	ル	ラ
		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
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	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	／
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(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	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	／
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	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	／
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	7	—	—	7	0.13	0.0	43.87	／	0	13.06	0	／
2	0.15以上0.25未満	28	—	—	28	0.21	0.0	44.02	／	5	18.45	0	／
3	0.25以上0.50未満	7,355	—	—	7,355	0.33	0.8	43.87	／	1,894	25.76	10	／
4	0.50以上0.75未満	12,273	—	—	12,273	0.57	1.9	43.87	／	4,606	37.53	30	／
5	0.75以上2.50未満	12,633	—	—	12,633	1.43	0.3	43.87	／	8,746	69.23	79	／
6	2.50以上10.00未満	627	—	—	627	8.67	0.0	43.87	／	1,178	187.82	23	／
7	10.00以上100.00未満	303	—	—	303	54.05	0.0	43.87	／	582	191.73	71	／
8	100.00(デフォルト)	457	—	—	457	100.00	0.0	40.30	／	357	78.12	184	／
9	小計	33,685	—	—	33,685	2.82	3.4	43.82	／	17,371	51.56	401	224
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	4	—	—	4	0.08	0.0	68.86	／	0	12.95	0	／
2	0.15以上0.25未満	13	—	—	13	0.18	0.0	43.87	／	2	17.02	0	／
3	0.25以上0.50未満	88,231	—	—	88,231	0.30	2.4	50.75	／	23,882	27.06	136	／
4	0.50以上0.75未満	425	—	—	425	0.72	0.4	82.25	／	307	72.19	2	／
5	0.75以上2.50未満	713	—	—	713	1.66	0.2	43.87	／	383	53.78	5	／
6	2.50以上10.00未満	—	—	—	—	—	—	—	／	—	—	—	／
7	10.00以上100.00未満	347	—	—	347	23.73	0.0	53.11	／	414	119.16	44	／
8	100.00(デフォルト)	634	—	—	634	100.00	0.0	48.06	／	606	95.52	305	／
9	小計	90,372	—	—	90,372	1.10	3.1	50.83	／	25,597	28.32	493	275
合計(全てのポートフォリオ)		2,820,267	44,179	41.58	2,838,638	0.27	7.9	33.91	1.7	324,945	11.44	2,271	1,269

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. 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(事業性と信を除く)においては、債権の数を開示しています。

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(基礎的内部格付手法適用分) (単位：百万円、%、千件、年)

項番PD 区分		2024年度中間期											
		イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ	ト	チ	リ	ヌ	ル	ラ
		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	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	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
金融機関等向けエクスポージャー													
1	0.00以上0.15未満	116,432	47,212	10.09	121,198	0.05	0.0	45.00	1.0	19,021	15.69	28	／
2	0.15以上0.25未満	200	—	—	200	0.18	0.0	20.00	4.7	55	27.96	0	／
3	0.25以上0.50未満	3,985	10,000	10.00	4,985	0.41	0.0	45.00	1.3	3,183	63.85	9	／
4	0.50以上0.75未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	／
5	0.75以上2.50未満	258	—	—	258	0.77	0.0	20.00	5.0	131	51.00	0	／
6	2.50以上10.00未満	110	132,102	10.00	13,320	2.70	0.0	44.79	1.0	14,087	105.75	161	／
7	10.00以上100.00未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	／
8	100.00(デフォルト)	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	／
9	小計	120,986	189,314	10.02	139,963	0.31	0.0	44.89	1.0	36,479	26.06	199	111
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	1,457,586	344,633	37.19	1,585,759	0.06	0.2	40.61	2.5	334,986	21.12	391	／
2	0.15以上0.25未満	49,827	5,245	40.00	51,926	0.18	0.0	38.40	2.0	17,026	32.79	37	／
3	0.25以上0.50未満	32,364	2,218	44.50	33,352	0.41	0.0	39.50	1.1	14,462	43.36	54	／
4	0.50以上0.75未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	／
5	0.75以上2.50未満	4,557	—	—	4,557	0.86	0.0	37.07	2.4	3,220	70.67	14	／
6	2.50以上10.00未満	25,423	6,250	40.00	27,923	2.71	0.0	40.00	1.1	32,221	115.39	303	／
7	10.00以上100.00未満	115	1	40.00	116	12.95	0.0	25.79	1.0	129	111.82	3	／
8	100.00(デフォルト)	19,097	380	16.33	19,159	100.00	0.0	—	1.3	—	—	6,133	／
9	小計	1,588,973	358,728	37.30	1,722,793	1.22	0.3	40.05	2.4	402,046	23.33	6,937	3,875
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	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
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	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	／	／
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)

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		2024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
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	3,086	—	—	3,086	0.05	0.0	40.00	0.1	170	5.52	0	／
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	3,086	—	—	3,086	0.05	0.0	40.00	0.1	170	5.52	0	0
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	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	／
2	0.15以上0.25未満	3,162	—	—	3,162	0.18	0.0	45.00	—	912	28.86	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	3,162	—	—	3,162	0.18	0.0	45.00	—	912	28.86	2	／
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	—	—	—	—	—	—	—	／	—	—	—	／
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	—	—	—	—	—	—	—	／	—	—	—	—
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	—	—	—	—	—	—	—	／	—	—	—	／
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)		1,716,208	548,042	27.88	1,869,005	1.15	0.4	40.42	2.3	439,610	23.52	7,140	3,987

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. 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(事業性と信を除く)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、%)

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		
簡易手法－上場株式	6,959	—	300%					6,959	20,878		
簡易手法－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、%)

2024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		—	—	—		—	—	—			

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)

		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。

(B) CR5a：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)

		2024年度中間期									
		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)									
	リスクウェイト	0%	20%	50%	100%	150%	その他	合計			
資産クラス											
1a	日本国政府及び日本銀行向け	10,029	—	—	—	—	—	—	10,029		
1b	外国の中央政府及び中央銀行向け	47,940	—	—	—	—	—	—	47,940		
1c	国際決済銀行等向け	—	—	—	—	—	—	—	—		
2a	我が国の地方公共団体向け	99	—	—	—	—	—	—	99		
2b	外国の中央政府等以外の公共部門向け	—	—	—	—	—	—	—	—		
2c	地方公共団体金融機構向け	—	—	—	—	—	—	—	—		
2d	我が国の政府関係機関向け	—	—	—	—	—	—	—	—		
2e	地方三公社向け	—	—	—	—	—	—	—	—		
3		0%	20%	30%	50%	100%	150%	その他	合計		
	国際開発銀行向け	—	—	—	—	—	—	—	—		
4		20%	30%	40%	50%	75%	100%	150%	その他	合計	
	金融機関、第一種金融商品取引業者及び保険会社向け	109,137	16,303	605	4,694	0	28	40	—	130,811	
	うち、第一種金融商品取引業者及び保険会社向け	580	68	46	—	0	—	—	—	695	
5		10%	15%	20%	25%	35%	50%	100%	その他	合計	
	カバード・ボンド向け	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
6		20%	50%	75%	80%	85%	100%	130%	150%	その他	合計
	法人等向け（特定貸付債権向けを含む。）	—	—	—	—	—	1,055	—	—	—	1,055
	うち、特定貸付債権向け	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
7a		100%	150%	250%	400%	その他	合計				
	劣後債権及びその他資本性証券等	—	—	—	—	—	—				
7b	株式等	148,326	—	—	—	—	148,326				
8		45%	75%	100%	その他	合計					
	中堅中小企業等向け及び個人向け	—	—	—	—	—					
9a		20%	25%	30%	40%	50%	70%	75%	その他	合計	
	不動産関連向け　うち、自己居住用不動産等向け	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
	うち、抵当権が第二順位以下で適格要件をみたすもの	20%	31.25%	37.5%	50%	62.5%	—		その他	合計	
		—	—	—	—	—	—		—	—	
9b		30%	35%	45%	60%	75%	105%	150%	その他	合計	
	不動産関連向け　うち、賃貸用不動産向け	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
	うち、抵当権が第二順位以下で適格要件をみたすもの	30%	43.75%	56.25%	75%	93.75%	—		その他	合計	
		—	—	—	—	—	—		—	—	
9c		70%	90%	110%	150%	その他	合計				
	不動産関連向け　うち、事業用不動産関連	—	—	—	—	—	—				
	うち、抵当権が第二順位以下で適格要件をみたすもの	70%	112.5%	—		—		その他	合計		
		—	—	—		—		—	—		
9d		60%				その他			合計		
	不動産関連向け　うち、その他不動産関連	—				—			—		
	うち、抵当権が第二順位以下で適格要件をみたすもの	60%				その他			合計		
		—				—			—		
9e		100%		150%		その他			合計		
	不動産関連向け　うち、ADC向け	—		—		—			—		
10a		50%		100%		150%		その他		合計	
	延滞等(自己居住用不動産等向けエクスポージャーを除く。)	—		—		—		—		—	
10b	自己居住用不動産等向けエクスポージャーに係る延滞	—		—		—		—		—	
11a		0%		10%		20%		その他		合計	
	現金	0		—		—		—		0	
11b		—		—		—		—		—	
	取立未済手形	—		—		—		—		—	
	信用保証協会等による保証付	—		—		—		—		—	
	株式会社地域経済活性化支援機構等による保証付	—		—		—		—		—	

注) 株式等エクスポージャーにおいて、内部格付手法で計測される場合に適用されるリスク・ウェイトと、標準的手法で計測される場合に適用されるリスク・ウェイトが同値の場合については、標準的手法を適用しているものとみなします。

みずほ信託銀行連結の自己資本の充実の状況

(C) CR5b：標準的手法ーリスク・ウェイト区分別の信用リスク・エクスポージャーとCCF

(単位：百万円)

項番	リスク・ウェイト	2024年度中間期			
		イ	ロ	ハ	ニ
		オン・バランスシートの エクスポージャーの額	オフ・バランスシートの エクスポージャーの額	CCFの加重平均値	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)
1	40%未満	183,510	—	—	183,510
2	40%-70%	5,300	—	—	5,300
3	75%	0	—	—	0
	80%	—	—	—	—
4	85%	—	—	—	—
5	90%-100%	149,410	—	—	149,410
6	105%-130%	—	—	—	—
7	150%	40	—	—	40
8	250%	—	—	—	—
9	400%	—	—	—	—
10	1250%	—	—	—	—
11	合計	338,262	—	—	338,262

注) 株式等エクスポージャーにおいて、内部格付手法で計測される場合に適用されるリスク・ウェイトと、標準的手法で計測される場合に適用されるリスク・ウェイトが同値の場合については、標準的手法を適用しているものとみなします。

(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		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カ月以上延滞債権、破綻先債権等が含まれています。

(単位：百万円)

項番		2024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	2,038,105	697,555	547,627	26,064	—
2	有価証券(負債性のもの)	31,282	59,811	46,060	—	—
3	その他オン・バランスシートの資産 (負債性のもの)	1,803,868	—	—	—	—
4	合計 (1 + 2 + 3)	3,873,256	757,366	593,687	26,064	—
5	うちデフォルトしたもの	11,002	10,329	5,235	4,347	—

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カ月以上延滞債権、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	2023年度中間期					
		イ		ロ		ハ	
		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・リスク・ウェイト アセットの額	
		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	の加重平均値 (RWA density)	
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

(単位：百万円、%)

項番	資産クラス	2024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		
1a	日本国政府及び日本銀行向け	10,029	—	10,029	—	—	—
1b	外国の中央政府及び中央銀行向け	47,940	—	47,940	—	—	—
1c	国際決済銀行等向け	—	—	—	—	—	—
2a	我が国の地方公共団体向け	99	—	99	—	—	—
2b	外国の中央政府等以外の公共部門向け	—	—	—	—	—	—
2c	地方公共団体金融機構向け	—	—	—	—	—	—
2d	我が国の政府関係機関向け	—	—	—	—	—	—
2e	地方三公社向け	—	—	—	—	—	—
3	国際開発銀行向け	—	—	—	—	—	—
4	金融機関、第一種金融商品取引業者及び保険会社向け	130,811	—	130,811	—	29,397	22.47
	うち、第一種金融商品取引業者及び保険会社向け	695	—	695	—	155	22.32
5	カバード・ボンド向け	—	—	—	—	—	—
6	法人等向け(特定貸付債権向けを含む。)	1,055	—	1,055	—	1,055	100.00
	うち、特定貸付債権向け	—	—	—	—	—	—
7a	劣後債権及びその他資本性証券等	—	—	—	—	—	—
7b	株式等	148,326	—	148,326	—	148,326	100.00
8	中堅中小企業等向け及び個人向け	—	—	—	—	—	—
	うち、トランザクター向け	—	—	—	—	—	—
9	不動産関連向け	—	—	—	—	—	—
	うち、自己居住用不動産等向け	—	—	—	—	—	—
	うち、賃貸用不動産向け	—	—	—	—	—	—
	うち、事業用不動産関連	—	—	—	—	—	—
	うち、その他不動産関連	—	—	—	—	—	—
	うち、ADC向け	—	—	—	—	—	—
10a	延滞等(自己居住用不動産等向けエクスポージャーを除く。)	—	—	—	—	—	—
10b	自己居住用不動産等向けエクスポージャーに係る延滞	—	—	—	—	—	—
11a	現金	0	—	0	—	—	—
11b	取立未済手形	—	—	—	—	—	—
	信用保証協会等による保証付	—	—	—	—	—	—
	株式会社地域経済活性化支援機構等による保証付	—	—	—	—	—	—
12	合計	338,262	—	338,262	—	178,779	52.85

注) 株式等エクスポージャーにおいて、内部格付手法で計測される場合に適用されるリスク・ウェイトと、標準的手法で計測される場合に適用されるリスク・ウェイトが同値の場合については、標準的手法を適用しているものとみなします。

(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)

		2023年度中間期	
		イ	ロ
項番	ポートフォリオ	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

(単位：百万円)

		2024年度中間期	
		イ	ロ
項番	ポートフォリオ	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	696	696
3	金融機関等向けエクスポージャー -FIRB	36,479	36,479
4	金融機関等向けエクスポージャー -AIRB	—	—
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	402,048	402,048
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	138,281	138,281
7	特定貸付債権 -FIRB	—	—
8	特定貸付債権 -AIRB	106,498	106,498
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	17,371	17,371
11	リテール -その他リテール向けエクスポージャー	25,597	25,597
12	購入債権 -FIRB	1,083	1,083
13	購入債権 -AIRB	—	—
14	合計	728,057	728,057

(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)

	2023年度中間期	2024年度中間期
	期末残高	期末残高
ルック・スルー方式	52,699	60,984
マンドート方式	—	—
蓋然性方式250%	—	969
蓋然性方式400%	753	—
フォールバック方式1250%	238	126
合計	53,692	62,079

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)

		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
項番							
1	SA-CCR	—	—	/	1.4	—	—
	カレント・エクスポージャー方式	—	—	/	/	—	—
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

(単位：百万円)

		2024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
項番							
1	SA-CCR	—	—	/	1.4	—	—
	カレント・エクスポージャー方式	—	—	/	/	—	—
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	/	/	/	/	1,096	679
4	信用リスク削減手法における包括的手法	/	/	/	/	43,812	—
5	エクスポージャー変動推計モデル	/	/	/	/	—	—
6	合計	/	/	/	/	/	679

(B) CCR2：CVAリスクに対する資本賦課

(単位：百万円)

		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)
項番			
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)

		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)								
リスク・ウェイト		0%	10%	20%	50%	75%	100%	150%	その他	合計
項番	業種									
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	—	—	—	—	—	—	—	—	—

(単位：百万円)

		2024年度中間期													
		イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ	ト	チ	リ	ヌ	ル	ヲ	ワ	カ
		与信相当額(信用リスク削減効果勘案後)													
リスク・ウェイト		0%	10%	20%	30%	40%	50%	75%	80%	85%	100%	130%	150%	その他	合計
項番	業種														
1	日本国政府及び日本銀行向け	190	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	190
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、第一種金融商品取引業者及び保険会社向け	—	—	232	59	—	—	—	—	—	—	—	—	—	291
11	法人等向け	—	—	—	—	—	—	—	—	—	37	—	—	—	37
12	中小企業等向け及び個人向け	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
13	上記以外	—	—	—	—	—	—	—	—	—	577	—	—	—	577
14	合計	190	—	232	59	—	—	—	—	—	614	—	—	—	1,096

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)

		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)
項番	PD区分							
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
		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)	
項番	PD区分							
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

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(先進的内部格付手法適用分)
(単位：百万円、%、千件、年)

項番 PD区分		2024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	43,812	0.00	0.0	36.78	5.0	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	43,812	0.00	0.0	36.78	5.0	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	—	—	—	—	—	—	—
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	—	—	—	—	—	—	—
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)

項番 PD区分		2024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)
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)		43,812	0.00	0.0	36.78	5.0	0	0.00

みずほ信託銀行連結の自己資本の充実の状況

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(基礎的内部格付手法適用分)

(単位：百万円、%、千件、年)

項番 PD区分		2024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)
サブリン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	—	—	—	—	—	—	—
金融機関等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	—	—	—	—	—	—	—
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)

項番 PD区分		2024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)
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)		—	—	—	—	—	—	—

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)

		2023年度中間期					
		イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ
		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
項番		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

(単位：百万円)

		2024年度中間期					
		イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ
		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
項番		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)	—	15,483	—	16,500	—	104,950
2	現金(外国通貨)	—	—	—	—	—	—
3	国内ソブリン債	—	—	—	—	104,974	—
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	—	—	—	—	—	—
9	合計	—	15,483	—	16,500	104,974	104,950

(F) ENC1：担保資産の状況

(単位：百万円)

		2024年度中間期			
		イ	ロ	ハ	ニ
		担保に供されている 資産の額	担保に供されていない 資産の額	合計	うち、証券化エク スポージャーの額
1	現金預け金	—	1,783,884	1,783,884	—
2	債券貸借取引支払保証金	—	104,950	104,950	—
3	買入金銭債権	—	15,403	15,403	1,725
4	金銭の信託	—	28,198	28,198	—
5	有価証券	—	285,998	285,998	—
6	貸出金	43,812	2,697,052	2,740,864	1,500
7	外国為替	—	8,760	8,760	—
8	その他資産	6,388	142,810	149,198	—
9	有形固定資産	—	92,008	92,008	—
10	無形固定資産	—	29,582	29,582	—
11	退職給付に係る資産	—	143,828	143,828	—
12	繰延税金資産	—	935	935	—
13	支払承諾見返	—	9,335	9,335	—
14	貸倒引当金	—	△5,110	△5,110	—
15	合計	50,200	5,337,637	5,387,837	3,225

(G) 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		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)	—	—

(単位：百万円)

項番		2024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)	—	—

みずほ信託銀行連結の自己資本の充実の状況

(H) CCR8：中央清算機関向けエクスポージャー

(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・ネットティングが承認された場合のネットティング・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・ネットティングが承認された場合のネットティング・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		2024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)	/	562
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。)	28,122	562
3	(i) 派生商品取引(上場以外)	28,122	562
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・ネットティングが承認された場合のネットティング・セット	—	—
7	分別管理されている当初証拠金	—	/
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・ネットティングが承認された場合のネットティング・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	—	—

■CVAリスク

(1) CVAリスクに関する定量的開示事項

(A) CVA1：限定的なBA-CVA

(単位：百万円)

項番		2024年度中間期	
		イ	ロ
		構成要素の額	BA-CVAによるCVAリスク相当額
1	CVAリスクのうち取引先共通の要素	—	—
2	CVAリスクのうち取引先固有の要素	—	—
3	合計	—	—

■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)

2023年度中間期										
		イロハ			ニホヘ			トチリ		
項番	原資産の種類	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		
		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	—	—	—	—	—	—	—	—	—

(単位：百万円)

		2024年度中間期								
		イロハ			ニホヘ			トチリ		
項番	原資産の種類	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		
		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)	—	—	—	6,725	—	6,725	—	—	—
2	担保付住宅ローン	—	—	—	1,725	—	1,725	—	—	—
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	—	—	—	—	—	—	—	—	—

みずほ信託銀行連結の自己資本の充実の状況

(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)

2023年度中間期										
項番	原資産の種類	イ ロ ハ			ニ ホ ヘ			ト チ リ		
		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		
		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)

2024年度中間期										
項番	原資産の種類	イ ロ ハ			ニ ホ ヘ			ト チ リ		
		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		
		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	—	—	—	—	—	—	—	—	—

(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)

		2023年度中間期									
		イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ	ト	チ		
		合計									
項番		資産譲渡型 証券化取引 (小計)	証券化	裏付けとなる リテール		ホールセール		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	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—

		2023年度中間期								
		リ	ヌ	ル	ヲ	ワ	カ	ヨ		
項番		合成型証券 化取引 (小計)	証券化		再証券化		シニア		非シニア	
			裏付けとなる リテール	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	—	—	—	—	—	—	—	—	

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)

		2024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					
項番					裏付けとなる リート		ホールセール		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	1,725	1,725	1,725	1,725	—	—	—	—	—	
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	5,000	5,000	5,000	5,000	—	—	—	—	—	
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が適用される証券化エクスポージャー	6,725	6,725	6,725	6,725	—	—	—	—	—	
7	外部格付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	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
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により算出した信用リスク・アセット	3,197	3,197	3,197	3,197	—	—	—	—	—	
11	外部格付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	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
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	255	255	255	255	—	—	—	—	—	
15	外部格付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	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
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	—	—	—	—	—	—	—	—	—	

		2024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 リート		再証券化			
							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	—	—	—	—	—	—	—	—
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	外部格付準拠方式又は内部評価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	—	—	—	—	—	—	—	—
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	—	—	—	—	—	—	—	—

(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)

		2023年度中間期									
		イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ	ト	チ		
		合計									
項番		資産譲渡型 証券化取引 (小計)	証券化	裏付けとなる リート		ホールセール		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	2,213	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	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—

		2023年度中間期								
		リ	ヌ	ル	ヲ	ワ	カ	ヨ		
項番		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		
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

(単位：百万円)

項番		2024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		シニア		非シニア
裏付けとなる リテール	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	—	—	—	—	—	—	—	—
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	外部格付準拠方式又は内部評価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	—	—	—	—	—	—	—	—
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		2024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		シニア		非シニア
	裏付けとなる リテール		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	—	—	—	—	—	—	—	—
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	外部格付準拠方式又は内部評価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	—	—	—	—	—	—	—	—
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	—	—	—	—	—	—	—	—

■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)

		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)
項番		
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	1,081
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	1,081

(B) MR3：簡易的方式によるマーケット・リスク相当額

(単位：百万円)

		2024年度中間期			
		イ	ロ	ハ	ニ
		オプション取引 以外の取引	オプション取引		
			簡便法により 算出した額	デルタ・プラス法 により算出した額	シナリオ法により 算出した額
項番					
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	コモディティ・リスクの額	—	—	—	—
4	外国為替リスクの額	1,762	—	—	—
5	証券化エクスポージャーに係る個別リスクの額	—	—	—	—
6	合計	1,762	—	—	—

(2) バンキング業務

(A) IRRBB1：金利リスク

(単位：百万円)

		イ		ハ	
		ΔEVE		ΔNII	
		2024年度中間期	2023年度中間期	2024年度中間期	2023年度中間期
項番					
1	上方パラレルシフト	4,125	0	△20,334	△21,789
2	下方パラレルシフト	0	3,609	20,489	20,242
3	スティープ化	3,768	1,698	/	/
4	フラット化	0	0	/	/
5	短期金利上昇	0	0	/	/
6	短期金利低下	35	2,522	/	/
7	最大値	4,125	3,609	20,489	20,242
		ホ		ヘ	
		2024年度中間期		2023年度中間期	
8	Tier1資本の額	488,870		471,524	

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0.2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。

みずほ信託銀行連結の自己資本の充実の状況

■オペレーショナル・リスク

(1) オペレーショナル・リスクに関する定量的開示事項

(A) OR1：オペレーショナル・リスク損失の推移

(単位：百万円、件)

		2024年度中間期										
		イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ	ト	チ	リ	ヌ	ル
項番		当中間 期末	前中間 期末	前々中間 期末	ハの前 中間期末	ニの前 中間期末	ホの前 中間期末	ヘの前 中間期末	トの前 中間期末	チの前 中間期末	リの前 中間期末	直近十年間 の平均
二百万円を超える損失を集計したもの												
1	ネットの損失の合計額 (特殊損失控除前)	104	12	21	415	6	81	—	11	58	8	71
2	損失の件数	4	3	4	2	3	4	—	3	6	1	3
3	特殊損失の総額	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
4	特殊損失の件数	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
5	ネットの損失の合計額 (特殊損失控除後)	104	12	21	415	6	81	—	11	58	8	71
千万円を超える損失を集計したもの												
6	ネットの損失の合計額 (特殊損失控除前)	88	—	—	415	—	68	—	—	33	—	60
7	損失の件数	1	—	—	2	—	2	—	—	1	—	—
8	特殊損失の総額	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
9	特殊損失の件数	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
10	ネットの損失の合計額 (特殊損失控除後)	88	—	—	415	—	68	—	—	33	—	60
オペレーショナル・リスク相当額の計測に関する事項												
11	ILMの算出への内部損 失データ利用の有無	有	有	有	有	有	有	有	有	有	有	有
12	項番11で内部損失デー タを利用していない場 合は、内部損失デー タの承認基準充足の有無	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—

注) みずほ信託銀行(株)以外の連結子会社については、自己資本比率告示第310条第1項の基準を満たさないため、ILMに保守的な見積値を用いています。

(B) OR2：BICの構成要素

(単位：百万円)

項番		2024年度中間期		
		イ 当中間期末	ロ 前中間期末	ハ 前々中間期末
1	ILDC	22,248		
2	資金運用収益	30,417	25,306	22,387
3	資金調達費用	10,530	7,908	6,803
4	金利収益資産	3,098,792	3,229,767	3,385,994
5	受取配当金	4,858	4,504	4,588
6	SC	168,151		
7	役務取引等収益	168,990	164,374	161,367
8	役務取引等費用	38,187	40,090	39,111
9	その他業務収益	—	—	169
10	その他業務費用	20	98	4
11	FC	8,398		
12	特定取引勘定のネット損益 (特定取引等のネット損益)	144	△4	△19
13	特定取引勘定以外の勘定のネット損益 (特定取引等以外の勘定のネット損益)	14,910	3,018	6,632
14	BI	198,798		
15	BIC	25,621		
16	除外特例の対象となる連結子法人等又は事業部門を含むBI	198,798		
17	除外特例によって除外したBI	—		

注) 自己資本比率告示第306条第1項第4号に定めるILMの値に保守的な見積値を用いる連結子会社毎に、同告示第305条第2項に定める算式によりBICを構成する各要素の額を算出しているため、項番1、6、11の各数値は、項番2～5、7～10、12、13の各数値から算出される額とは一致しません。

(C) OR3：オペレーショナル・リスクに対する所要自己資本額の概要

(単位：百万円)

項番		2024年度中間期
1	BIC	25,621
2	ILM	0.67
3	オペレーショナル・リスク相当額	17,173
4	オペレーショナル・リスク・アセットの額	214,670

■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	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	3,881,644
1a	1		連結貸借対照表における総資産の額	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(△)	88,652
2		7	Tier1資本に係る調整項目の額(△)	115,865
3			オン・バランス資産の額 (イ)	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	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	13,588
			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	—
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)	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	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	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)	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	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(△)	251,189
19	6		オフ・バランス取引に関する額 (ニ)	229,527
5. 連結レバレッジ比率				
20			資本の額 (ホ)	471,524
21	8		総エクスポージャーの額((イ)+(ロ)+(ハ)+(ニ)) (ヘ)	4,070,999
22			連結レバレッジ比率((ホ)/(ヘ))	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)	4,070,999
			日本銀行に対する預け金の額	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')	6,510,513
			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'))	7.24%

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。

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)

項番(国際様式(LR1) の該当番号)	項目	2024年度中間期
1	連結貸借対照表における総資産の額	5,387,837
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(△)	—
3	リスク移転の認識に係る要件を充足しない証券化エクスポージャーに係る調整	—
4	中央銀行預け金に係る除外による調整(△)	1,607,673
5	顧客資産のうち、連結貸借対照表に計上されている金額(△)	/
6	有価証券の売買を約定日基準により会計処理している場合における調整項目	—
7	キャッシュ・プーリング契約に基づく資金の移動に係る調整項目	—
8	デリバティブ取引等に関する調整額	△1,831
8a	デリバティブ取引等に関する額	26,699
8b	デリバティブ取引等に関連する資産の額(△)	28,531
9	レポ取引等に関する調整額	—
9a	レポ取引等に関する額	104,950
9b	レポ取引等に関する額(△)	104,950
10	オフ・バランス取引に関する額	222,203
11	Tier1 資本に係る調整項目の額(貸倒引当金)(△)	4,260
12	その他の調整項目	△132,935
12a	Tier1 資本に係る調整項目の額(貸倒引当金以外)(△)	123,600
12b	支払承諾見返勘定の額(△)	9,335
12c	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(相殺した額に相当する部分に限る。)	—
12d	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(△)	—
12e	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。)	—
13	総エクスポージャーの額	3,863,339

(単位：百万円、%)

項番(国際様式(LR2)の該当番号) 項目		2024年度中間期
オン・バランス資産の額 (1)		
1	個別項目調整前のオン・バランス資産の額	3,637,345
2	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(相殺した額に相当する部分に限る。)	—
3	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(△)	—
4	レポ取引等により受領した証券の計上額(△)	—
5	Tier1資本に係る調整項目の額(貸倒引当金)(△)	4,260
6	Tier1資本に係る調整項目の額(貸倒引当金以外)(△)	123,600
7	オン・バランス資産の額 (イ)	3,509,485
デリバティブ取引等に関する額 (2)		
8	デリバティブ取引等に関するRCの額に1.4を乗じた額	21,717
9	デリバティブ取引等に関するPFEの額に1.4を乗じた額	4,981
10	間接清算参加者に適格中央清算機関の債務履行を保証していない場合に零とした中央清算機関向けエクスポージャーの額(△)	—
11	クレジット・デリバティブ等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	—
12	クレジット・デリバティブ等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(△)	—
13	デリバティブ取引等に関する額 (ロ)	26,699
レポ取引等に関する額 (3)		
14	レポ取引等に関する資産の額	104,950
15	レポ取引等に関する資産の額から控除した額(△)	—
16	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	—
17	代理取引のエクスポージャーの額	/
18	レポ取引等に関する額 (ハ)	104,950
オフ・バランス取引に関する額 (4)		
19	オフ・バランス取引の想定元本の額	645,333
20	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(△)	423,129
22	オフ・バランス取引に関する額 (ニ)	222,203
連結レバレッジ比率 (5)		
23	資本の額 (ホ)	488,870
24	総エクスポージャーの額((イ)+(ロ)+(ハ)+(ニ)) (ヘ)	3,863,339
25	連結レバレッジ比率((ホ)/(ヘ))	12.65%
26	適用する所要連結レバレッジ比率	3.15%
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 (6)		
	総エクスポージャーの額 (ヘ)	3,863,339
	日本銀行に対する預け金の額	1,607,673
	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')	5,471,013
	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'))	8.93%
平均値の開示 (7)		
28	レポ取引等に関する資産の額(控除後)に係る平均値((ト)+(チ))	83,227
	レポ取引等に関する資産の額に係る平均値 (ト)	83,227
	レポ取引等に関する資産の額から控除した額に係る平均値(△) (チ)	—
29	レポ取引等に関する資産の額(控除後)に係る四半期末の値((リ)+(ヌ))	104,950
14	レポ取引等に関する資産の額に係る四半期末の値 (リ)	104,950
15	レポ取引等に関する資産の額から控除した額に係る四半期末の値(△) (ヌ)	—
30	総エクスポージャーの額(レポ取引等に関する資産の額(控除後)に係る平均値を使用し、日本銀行に対する預け金を算入しない場合) (ル)	3,841,616
30a	総エクスポージャーの額(レポ取引等に関する資産の額(控除後)に係る平均値を使用し、日本銀行に対する預け金を算入する場合) (ヲ)	5,449,290
31	連結レバレッジ比率(レポ取引等に関する資産の額(控除後)に係る平均値を使用し、日本銀行に対する預け金を算入しない場合)((ホ)/(ル))	12.72%
31a	連結レバレッジ比率(レポ取引等に関する資産の額(控除後)に係る平均値を使用し、日本銀行に対する預け金を算入する場合)((ホ)/(ヲ))	8.97%

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。

(2) 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の額が減少したものの。

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		2024年度第1四半期		2024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	1,468,339		1,853,752	
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	1,465,103	129,567	1,447,618	127,782
3	うち、安定預金の額	243,081	7,292	243,514	7,305
4	うち、準安定預金の額	1,222,022	122,275	1,204,104	120,477
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,156,211	839,717	1,397,775	939,402
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	1,114,382	797,888	1,395,186	936,813
8	うち、負債性有価証券の額	41,829	41,829	2,589	2,589
9	有担保資金調達等に係る資金流出額	／	—	／	1
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	361,236	82,186	354,047	82,350
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	18,881	18,881	18,881	18,881
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	342,354	63,304	335,165	63,468
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	17,463	15,341	8,547	6,459
15	偶発事象に係る資金流出額	956,538	1,530	940,464	1,469
16	資金流出合計額	／	1,068,344	／	1,157,466
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	39,833	—	33,162	—
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	221,875	168,701	242,486	173,069
19	その他資金流入額	26,401	15,569	26,513	21,212
20	資金流入合計額	288,110	184,270	302,162	194,281
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	／	1,468,339	／	1,853,752
22	純資金流出額	／	884,073	／	963,185
23	連結流動性カバレッジ比率	／	168.0%	／	192.9%
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おりません。

(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		2024年度第1四半期					2024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月未満	6月以上1年未満	1年以上		満期なし	6月未満	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	616,786	—	—	—	616,786	622,930	—	—	—	622,930
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	616,786	—	—	—	616,786	622,930	—	—	—	622,930
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	1,469,687	—	—	—	1,334,770	1,424,112	—	—	—	1,293,938
5	うち、安定預金等の額	241,036	—	—	—	228,984	244,734	—	—	—	232,497
6	うち、準安定預金等の額	1,228,650	—	—	—	1,105,785	1,179,378	—	—	—	1,061,440
7	ホールセール資金調達	722,417	1,463,519	216,820	611,757	1,383,247	909,765	1,298,246	361,223	707,122	1,574,497
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	722,417	1,463,519	216,820	611,757	1,383,247	909,765	1,298,246	361,223	707,122	1,574,497
10	相互に関係する資産がある負債	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
11	その他の負債	101,912	—	—	—	26,369	98,799	—	—	—	24,278
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	101,912	—	—	—	26,369	98,799	—	—	—	24,278
14	利用可能安定調達額合計	/	/	/	/	3,361,174	/	/	/	/	3,515,644
所要安定調達額（2）											
15	流動資産の額	/	/	/	/	73,554	/	/	/	/	69,750
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	6,351	—	—	—	3,175	8,760	—	—	—	4,380
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	282,225	711,097	157,269	2,234,010	2,395,514	196,991	562,475	242,306	2,185,136	2,282,131
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	—	150,049	—	—	129,983	—	104,950	—	—	84,979
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	248,567	147,809	37,440	275,583	353,775	164,991	137,496	47,492	277,432	346,609
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。）	281	357,110	118,724	1,879,169	1,791,633	271	263,947	193,630	1,829,977	1,732,988
21	うち、リスク・ウェイトが35%以下の資産の額	—	43,543	15,797	228,306	178,070	—	28,001	30,740	266,657	202,699
22	うち、住宅ローン債権	0	925	915	17,222	11,326	0	907	880	16,667	10,945
23	うち、リスク・ウェイトが35%以下の資産の額	0	854	843	16,119	11,326	0	840	815	15,565	10,945
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	33,377	55,201	188	62,035	108,795	31,728	55,173	303	61,058	106,607
25	相互に関係する負債がある資産	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
26	その他の資産等	470,775	6,427	1,153	34,346	509,862	385,820	6,564	1,316	36,140	427,311
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	/	/	/	16,500	14,025
29	うち、デリバティブ資産の額	/	/	/	—	—	/	/	/	1,729	1,729
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	470,775	6,427	1,153	17,846	495,837	385,820	6,564	1,316	17,910	411,556
32	オフ・バランス取引	/	/	/	1,281,371	18,376	/	/	/	1,266,357	18,166
33	所要安定調達額合計	/	/	/	/	3,000,483	/	/	/	/	2,801,739
34	連結安定調達比率	/	/	/	/	112.0%	/	/	/	/	125.4%

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、過去3年間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います。

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
		2024年度 第2四半期末	2024年度 第1四半期末	2023年度 第4四半期末	2023年度 第3四半期末	2023年度 第2四半期末
資本						
1	普通株式等Tier 1 資本の額	452,595	445,836	446,717	456,394	447,032
2	Tier 1 資本の額	452,595	445,836	446,717	456,394	447,032
3	総自己資本の額	452,695	445,920	446,816	456,502	447,171
リスク・アセット						
4	リスク・アセットの額	1,448,401	1,511,796	1,561,787	1,610,706	1,639,465
4a	リスク・アセットの額(フロア調整前)	1,448,401	1,511,796	1,561,787	/	/
	リスク・アセットの額(フロア調整最終実施ベース)	1,864,448	1,949,142	2,017,352	/	/
自己資本比率						
5	普通株式等Tier 1 比率	31.24%	29.49%	28.60%	28.33%	27.26%
5a	普通株式等Tier1比率(フロア調整前)	31.24%	29.49%	28.60%	/	/
	普通株式等Tier1比率(フロア調整最終実施ベース)	24.27%	22.87%	22.14%	/	/
6	Tier 1 比率	31.24%	29.49%	28.60%	28.33%	27.26%
6a	Tier1比率(フロア調整前)	31.24%	29.49%	28.60%	/	/
	Tier1比率(フロア調整最終実施ベース)	24.27%	22.87%	22.14%	/	/
7	総自己資本比率	31.25%	29.49%	28.60%	28.34%	27.27%
7a	総自己資本比率(フロア調整前)	31.25%	29.49%	28.60%	/	/
	総自己資本比率(フロア調整最終実施ベース)	24.28%	22.87%	22.14%	/	/
単体レバレッジ比率						
13	総エクスポージャーの額	3,695,671	3,964,545	3,949,597	3,979,977	3,968,132
14	単体レバレッジ比率	12.24%	11.24%	11.31%	11.46%	11.26%
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	1,780,331	1,384,154	2,435,144	2,436,855	2,591,104
16	純資金流出額	860,984	789,385	1,636,563	1,802,335	1,793,613
17	単体流動性カバレッジ比率	207.7%	177.9%	153.0%	135.8%	145.3%
単体安定調達比率						
18	利用可能安定調達額	3,440,640	3,286,283	3,349,816	3,373,322	3,445,147
19	所要安定調達額	2,724,603	2,925,797	2,866,019	2,869,520	2,928,385
20	単体安定調達比率	126.2%	112.3%	116.8%	117.5%	117.6%

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 2023年度 中間期	ロ 2024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	439,247	447,545	
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	256,372	264,670	
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	普通株式に係る株式引受権及び新株予約権の合計額	—	—	
3	評価・換算差額等及びその他公表準備金の額	85,794	87,081	(a)
6	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額 (イ)	525,041	534,626	
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	13,034	12,976	
8	うちのれんに係るものの額	206	162	
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	12,828	12,813	
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	10,367	6,028	
12	適格引当金不足額	2,267	4,263	
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	52,339	58,762	
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連するものの額	—	—	
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連するものの額	—	—	
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)	78,008	82,031	
普通株式等Tier1資本				
29	普通株式等Tier1資本の額((イ)-(ロ)) (ハ)	447,032	452,595	

(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 2023年度 中間期	ロ 2024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株式引受権及び新株予約権の合計額	—	—	
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	—	—	
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)	447,032	452,595	
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株式引受権及び新株予約権の合計額	—	—	
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	—	—	
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	138	100	
50a	うち一般貸倒引当金Tier2算入額	138	100	
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)	138	100	

(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 2023年度 中間期	ロ 2024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)	138	100	
総自己資本				
59	総自己資本の額((ト)＋(ヌ)) (ル)	447,171	452,695	
リスク・アセット (6)				
60	リスク・アセットの額 (ヲ)	1,639,465	1,448,401	
自己資本比率 (7)				
61	普通株式等Tier1比率((ハ)／(ヲ))	27.26%	31.24%	
62	Tier1比率((ト)／(ヲ))	27.26%	31.24%	
63	総自己資本比率((ル)／(ヲ))	27.27%	31.25%	
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	10,724	9,693	
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	345	3,062	
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	—	—	
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	138	100	
77	一般貸倒引当金に係るTier2資本算入上限額	973	485	
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	7,753	6,813	

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			ハ 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
	イ	ロ		
	公表 中間貸借対照表 2023年度中間期	公表 中間貸借対照表 2024年度中間期		
(資産の部)				
現金預け金	2,455,687	1,628,628		
債券貸借取引支払保証金	40,318	104,950		
買入金銭債権	39,541	15,403		
金銭の信託	26,001	28,198		
有価証券	277,252	276,000		6-b
貸出金	2,946,923	2,748,796		6-c
外国為替	6,336	9,661		
その他資産	228,315	137,692		6-d
有形固定資産	92,644	91,186		
無形固定資産	18,695	18,631		2
前払年金費用	75,438	84,696		3
支払承諾見返	13,909	9,335		
貸倒引当金	△2,673	△4,973		
資産の部合計	6,218,391	5,148,209		
(負債の部)				
預金	2,801,914	2,622,436		
譲渡性預金	385,550	358,880		
コールマネー	1,008,231	7,766		
借入金	326,100	501,500		7-a
信託勘定借	1,083,338	1,033,963		
その他負債	38,852	39,739		6-f
賞与引当金	1,648	5,231		
変動報酬引当金	136	172		
偶発損失引当金	—	50		
退職給付引当金	785	—		
睡眠預金払戻損失引当金	594	423		
繰延税金負債	32,288	34,083		4-b
支払承諾	13,909	9,335		
負債の部合計	5,693,349	4,613,583		
(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	256,372	264,670		1-c
自己株式	△79,999	△79,999		1-d
株主資本合計	439,247	447,545		
その他有価証券評価差額金	75,426	81,052		
繰延ヘッジ損益	10,367	6,028		5
評価・換算差額等合計	85,794	87,081		
純資産の部合計	525,041	534,626	(a)	
負債及び純資産の部合計	6,218,391	5,148,209		

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	2023年度 中間期	2024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	256,372	264,670	
1-d	自己株式	△79,999	△79,999	
	株主資本合計	439,247	447,545	

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	2023年度 中間期	2024年度 中間期	備考
	普通株式等Tier1資本に係る額	439,247	447,545	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	256,372	264,670	
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	2023年度 中間期	2024年度 中間期	備考
2	無形固定資産	18,695	18,631	
	上記に係る税効果	△5,661	△5,655	

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	2023年度 中間期	2024年度 中間期	備考
8	無形固定資産 のれんに係るもの	206	162	
9	無形固定資産 その他の無形固定資産	12,828	12,813	のれん、モーゲージ・サービシング・ライツ以外(ソフトウェア等)
	無形固定資産 モーゲージ・サービシング・ライツ	—	—	
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・ライツに係るものに限り。)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	2023年度 中間期	2024年度 中間期	備考
3	前払年金費用	75,438	84,696	
	上記に係る税効果	△23,099	△25,934	

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	2023年度 中間期	2024年度 中間期	備考
15	前払年金費用の額	52,339	58,762	

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	2023年度 中間期	2024年度 中間期	備考
	繰延税金資産	—	—	
4-b	繰延税金負債	32,288	34,083	
	無形固定資産の税効果勘案分	5,661	5,655	
	前払年金費用の税効果勘案分	23,099	25,934	

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	2023年度 中間期	2024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	—	—	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. 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	2023年度 中間期	2024年度 中間期	備考
5	繰延ヘッジ損益	10,367	6,028	

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	2023年度 中間期	2024年度 中間期	備考
11	繰延ヘッジ損益の額	10,367	6,028	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	2023年度 中間期	2024年度 中間期	備考
	特定取引資産	—	—	
6-b	有価証券	277,252	276,000	
6-c	貸出金	2,946,923	2,748,796	
6-d	その他資産	228,315	137,692	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	38,852	39,739	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	2023年度 中間期	2024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	10,724	9,693	
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	10,724	9,693	
	その他金融機関等(10%超出資)	345	3,062	
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	345	3,062	

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	2023年度 中間期	2024年度 中間期	備考
7-a	借入金	326,100	501,500	
	社債	—	—	
	合計	326,100	501,500	

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	2023年度 中間期	2024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	
		リスク・アセット		所要自己資本	
		2023年度中間期		2023年度中間期	
1	信用リスク	1,133,144		95,245	
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		81,156	
	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		14,088	
4	カウンターパーティ信用リスク	6,285		529	
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		56	
	その他	5,580		473	
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		10,004	
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		3,628	
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		1	
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		184	
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		184	
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		11	
17	うち、標準的方式適用分	140		11	
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		21,480	
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		21,480	
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		73	
	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)	1,639,465		131,157	

みずほ信託銀行単体の自己資本の充実の状況

(単位：百万円)

国際様式の 概要番号		イ		ロ	
		リスク・アセット		所要自己資本	
		2024年度中間期		2024年度中間期	
1	信用リスク	1,089,537		87,162	
2	うち、標準的手法適用分	156,397		12,511	
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	441,537		35,323	
4	うち、スロットティング・クライテリア適用分	—		—	
5	うち、先進的内部格付手法適用分	356,158		28,492	
	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	135,443		10,835	
6	カウンターパーティ信用リスク	2,449		195	
7	うち、SA-CCR適用分	—		—	
8	うち、期待エクスポージャー方式適用分	—		—	
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	562		44	
9	その他	1,887		150	
10	CVAリスク	—		—	
	うち、SA-CVA適用分	—		—	
	うち、完全なBA-CVA適用分	—		—	
	うち、限定的なBA-CVA適用分	—		—	
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	131,604		10,528	
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)	35,619		2,849	
13	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算(マンドート方式)	—		—	
	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算(蓋然性方式250%)	—		—	
	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算(蓋然性方式400%)	—		—	
14	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算(フォールバック方式1250%)	1,544		123	
15	未決済取引	—		—	
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	3,197		255	
17	うち、内部格付手法準拠方式適用分	3,197		255	
18	うち、外部格付準拠方式又は内部評価方式適用分	—		—	
19	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	—		—	
20	マーケット・リスク	22,041		1,763	
21	うち、標準的方式適用分	—		—	
22	うち、内部モデル方式適用分	—		—	
	うち、簡易的方式適用分	22,041		1,763	
23	勘定間の振替分	—		—	
24	オペレーショナル・リスク	154,752		12,380	
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	7,655		612	
26	フロア調整	—		—	
27	合計	1,448,401		115,872	

注) 株式等エクスポージャーにおいて、内部格付手法で計測される場合に適用されるリスク・ウェイトと、標準的手法で計測される場合に適用されるリスク・ウェイトが同値の場合については、標準的手法を適用しているものとみなします。

■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			
		2024年度中間期		2023年度中間期		2024年度中間期		2023年度中間期	
1	上方パラレルシフト	4,125		0		△20,334		△21,789	
2	下方パラレルシフト	0		3,609		20,489		20,242	
3	スティープ化	3,768		1,698		／		／	
4	フラット化	0		0		／		／	
5	短期金利上昇	0		0		／		／	
6	短期金利低下	35		2,522		／		／	
7	最大値	4,125		3,609		20,489		20,242	
		ホ				ヘ			
		2024年度中間期				2023年度中間期			
8	Tier1資本の額	452,595				447,032			

- 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0.2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。

みずほ信託銀行単体の自己資本の充実の状況

■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	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	3,690,224
1 a	1	貸借対照表における総資産の額	3,778,877
1 b	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(△)	88,652
2	7	Tier1資本に係る調整項目の額(△)	67,640
3		オン・バランス資産の額 (イ)	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	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	13,588
		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	—
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)	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	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	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)	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	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(△)	252,269
19	6	オフ・バランス取引に関する額 (二)	229,647
5. 単体レバレッジ比率			
20		資本の額 (ホ)	447,032
21	8	総エクスポージャーの額((イ)+(ロ)+(ハ)+(二)) (ヘ)	3,968,132
22		単体レバレッジ比率((ホ)/(ヘ))	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)	3,968,132
		日本銀行に対する預け金の額	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')	6,407,646
		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'))	6.97%

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。

(単位：百万円)

項番(国際様式(LR1) の該当番号)	項目	2024年度中間期
1	貸借対照表における総資産の額	5,148,209
3	リスク移転の認識に係る要件を充足しない証券化エクスポージャーに係る調整	—
4	中央銀行預け金に係る除外による調整(△)	1,607,673
5	顧客資産のうち、貸借対照表に計上されている金額(△)	/
6	有価証券の売買を約定日基準により会計処理している場合における調整項目	—
7	キャッシュ・プーリング契約に基づく資金の移動に係る調整項目	—
8	デリバティブ取引等に関する調整額	△1,831
8a	デリバティブ取引等に関する額	26,699
8b	デリバティブ取引等に関連する資産の額(△)	28,531
9	レボ取引等に関する調整額	19,981
9a	レボ取引等に関する額	124,932
9b	レボ取引等に関する額(△)	104,950
10	オフ・バランス取引に関する額	222,324
11	Tier1資本に係る調整項目の額(貸倒引当金)(△)	4,263
12	その他の調整項目	△81,074
12a	Tier1資本に係る調整項目の額(貸倒引当金以外)(△)	71,738
12b	支払承諾見返勘定の額(△)	9,335
12c	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(相殺した額に相当する部分に限る。)	—
12d	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(△)	—
13	総エクスポージャーの額	3,695,671

みずほ信託銀行単体の自己資本の充実の状況

(単位：百万円、%)

項番(国際様式(LR2)の該当番号)	項目		2024年度中間期
オン・バランス資産の額 (1)			
1	個別項目調整前のオン・バランス資産の額		3,397,717
2	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(相殺した額に相当する部分に限る。)		—
3	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(△)		—
4	レポ取引等により受領した証券の計上額(△)		—
5	Tier1資本に係る調整項目の額(貸倒引当金)(△)		4,263
6	Tier1資本に係る調整項目の額(貸倒引当金以外)(△)		71,738
7	オン・バランス資産の額	(イ)	3,321,715
デリバティブ取引等に関する額 (2)			
8	デリバティブ取引等に関するRCの額に1.4を乗じた額		21,717
9	デリバティブ取引等に関するPFEの額に1.4を乗じた額		4,981
10	間接清算参加者に適格中央清算機関の債務履行を保証していない場合に零とした中央清算機関向けエクスポージャーの額(△)		—
11	クレジット・デリバティブ等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		—
12	クレジット・デリバティブ等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(△)		—
13	デリバティブ取引等に関する額	(ロ)	26,699
レポ取引等に関する額 (3)			
14	レポ取引等に関する資産の額		104,950
15	レポ取引等に関する資産の額から控除した額(△)		—
16	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		19,981
17	代理取引のエクスポージャーの額		/
18	レポ取引等に関する額	(ハ)	124,932
オフ・バランス取引に関する額 (4)			
19	オフ・バランス取引の想定元本の額		646,534
20	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(△)		424,209
22	オフ・バランス取引に関する額	(ニ)	222,324
単体レバレッジ比率 (5)			
23	資本の額	(ホ)	452,595
24	総エクスポージャーの額((イ)+(ロ)+(ハ)+(ニ))	(ヘ)	3,695,671
25	単体レバレッジ比率((ホ)/(ヘ))		12.24%
26	適用する所要単体レバレッジ比率		3.15%
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 (6)			
	総エクスポージャーの額	(ヘ)	3,695,671
	日本銀行に対する預け金の額		1,607,673
	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')		5,303,345
	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'))		8.53%
平均値の開示 (7)			
28	レポ取引等に関する資産の額(控除後)に係る平均値((ト)+(チ))		83,227
	レポ取引等に関する資産の額に係る平均値	(ト)	83,227
	レポ取引等に関する資産の額から控除した額に係る平均値(△)	(チ)	—
29	レポ取引等に関する資産の額(控除後)に係る四半期末の値((リ)+(ヌ))		104,950
14	レポ取引等に関する資産の額に係る四半期末の値	(リ)	104,950
15	レポ取引等に関する資産の額から控除した額に係る四半期末の値(△)	(ヌ)	—
30	総エクスポージャーの額(レポ取引等に関する資産の額(控除後)に係る平均値を使用し、日本銀行に対する預け金を算入しない場合)	(ル)	3,673,948
30a	総エクスポージャーの額(レポ取引等に関する資産の額(控除後)に係る平均値を使用し、日本銀行に対する預け金を算入する場合)	(ヲ)	5,281,622
31	単体レバレッジ比率(レポ取引等に関する資産の額(控除後)に係る平均値を使用し、日本銀行に対する預け金を算入しない場合)((ホ)/(ル))		12.31%
31a	単体レバレッジ比率(レポ取引等に関する資産の額(控除後)に係る平均値を使用し、日本銀行に対する預け金を算入する場合)((ホ)/(ヲ))		8.56%

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。

(2) 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の額が減少したものの。

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	2024年度第1四半期		2024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	1,384,154		1,780,331	
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	1,465,103	129,567	1,447,622	127,783
3 うち、安定預金の額	243,081	7,292	243,514	7,305
4 うち、準安定預金の額	1,222,022	122,275	1,204,108	120,477
5 ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,029,658	713,164	1,269,152	810,779
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	987,829	671,335	1,266,563	808,190
8 うち、負債性有価証券の額	41,829	41,829	2,589	2,589
9 有担保資金調達等に係る資金流出額	／	—	／	1
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	361,236	82,186	354,046	82,350
11 うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	18,881	18,881	18,881	18,881
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	342,354	63,304	335,165	63,468
14 資金提供義務に基づく資金流出額等	10,911	8,788	3,230	1,142
15 偶発事象に係る資金流出額	957,738	1,566	941,665	1,505
16 資金流出合計額	／	935,274	／	1,023,562
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	39,833	—	33,162	—
18 貸付金等の回収に係る資金流入額	183,717	130,543	204,945	135,528
19 その他資金流入額	15,401	15,345	27,502	27,049
20 資金流入合計額	238,952	145,889	265,610	162,577
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	／	1,384,154	／	1,780,331
22 純資金流出額	／	789,385	／	860,984
23 単体流動性カバレッジ比率	／	177.9%	／	207.7%
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LCR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。

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LCR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。

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

■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		2024年度第1四半期					2024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月未満	6月以上1年未満	1年以上		満期なし	6月未満	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	531,158	—	—	—	531,158	534,711	—	—	—	534,711
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	531,158	—	—	—	531,158	534,711	—	—	—	534,711
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	1,469,687	—	—	—	1,334,770	1,424,120	—	—	—	1,293,945
5	うち、安定預金等の額	241,036	—	—	—	228,984	244,734	—	—	—	232,497
6	うち、準安定預金等の額	1,228,650	—	—	—	1,105,785	1,179,385	—	—	—	1,061,447
7	ホールセール資金調達	601,574	1,463,388	216,820	611,757	1,393,985	790,526	1,298,246	361,223	707,122	1,587,705
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	601,574	1,463,388	216,820	611,757	1,393,985	790,526	1,298,246	361,223	707,122	1,587,705
10	相互に関係する資産がある負債	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
11	その他の負債	69,798	—	—	—	26,369	66,658	—	—	—	24,278
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	69,798	—	—	—	26,369	66,658	—	—	—	24,278
14	利用可能安定調達額合計	/	/	/	/	3,286,283	/	/	/	/	3,440,640
所要安定調達額（2）											
15	流動資産の額	/	/	/	/	73,554	/	/	/	/	69,750
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	7,614	—	—	—	3,807	9,661	—	—	—	4,830
17	貸出金又はレポ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	196,586	679,380	157,269	2,245,010	2,390,973	111,680	523,736	242,306	2,193,136	2,271,464
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ポ形式の取引による額	—	150,049	—	—	129,983	—	104,950	—	—	84,979
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ポ形式の取引による額	159,961	116,093	37,440	286,583	346,711	79,682	98,757	47,492	285,432	335,944
20	うち、貸出金又はレポ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。）	281	357,110	118,724	1,879,169	1,791,633	271	263,947	193,630	1,829,977	1,732,988
21	うち、リスク・ウェイトが35%以下の資産の額	—	43,543	15,797	228,306	178,070	—	28,001	30,740	266,657	202,699
22	うち、住宅ローン債権	0	925	915	17,222	11,326	0	907	880	16,667	10,945
23	うち、リスク・ウェイトが35%以下の資産の額	0	854	843	16,119	11,326	0	840	815	15,565	10,945
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	36,344	55,201	188	62,035	111,318	31,725	55,173	303	61,058	106,605
25	相互に関係する負債がある資産	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
26	その他の資産等	399,963	6,427	1,153	34,346	439,050	318,865	6,564	1,316	36,140	360,356
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	/	/	/	16,500	14,025
29	うち、デリバティブ資産の額	/	/	/	—	—	/	/	/	1,729	1,729
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	399,963	6,427	1,153	17,846	425,025	318,865	6,564	1,316	17,910	344,601
32	オフ・バランス取引	/	/	/	1,282,572	18,412	/	/	/	1,267,558	18,202
33	所要安定調達額合計	/	/	/	/	2,925,797	/	/	/	/	2,724,603
34	単体安定調達比率	/	/	/	/	112.3%	/	/	/	/	126.2%

(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、過去3年間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います。