

各位

会社名 みずほアセット信託銀行株式会社  
(コード番号 8404 東証・大証第一部)

### 四半期情報の開示について

当社の平成15年3月期第3四半期における四半期情報について、お知らせします。

以下に掲げる四半期情報は、経済対策閣僚会議「改革先行プログラム」及び金融庁「証券市場の構造改革プログラム」の趣旨等を踏まえ、任意の会社情報として開示するものです。

(注) 以下に記載する第1四半期(平成14年6月末)及び第3四半期(平成14年12月末)数値は、監査を受けておりません。

#### 1. 「金融再生法ベースのカテゴリーによる開示」(単体)

		平成14年12月末	平成14年6月末	(参考) (単位:億円) 平成14年9月末(実績)
破産更生債権及びこれらに準ずる債権		395	556	492
	銀行勘定	237	329	320
	信託勘定	158	226	172
危険債権		1,700	1,782	1,627
	銀行勘定	1,621	1,670	1,531
	信託勘定	79	112	95
要管理債権		2,277	2,453	2,397
	銀行勘定	1,986	2,129	2,102
	信託勘定	291	323	295
合計		4,373	4,792	4,517
	銀行勘定	3,844	4,130	3,954
	信託勘定	528	662	563

- (注) 1. 信託勘定は元本補てん契約のある信託勘定を示しております。  
2. 今回の開示に際しまして、上記の平成14年12月末及び6月末の数値は、内部監査及び外部監査を除き、決算(含む中間)時と同様の方法で集計を行い、「金融機能の再生のための緊急措置に関する法律施行規則」第4条に規定する各債権のカテゴリーにより分類しております。

即ち、平成14年12月末及び6月末時点で存するすべての債権について、金融庁の「金融検査マニュアル」等に準拠し制定した厳正な「自己査定基準」に則り、営業関連部署がお取引先の信用状況に応じ、5つの債務者区分(破綻先、実質破綻先、破綻懸念先、要注意先、正常先)に区分し、各々の債務者区分毎に担保・保証等による債権の回収可能性を評価したものについて、独立した審査部門が2次査定を行った結果等に基づくものであります。

この結果に基づき、「破綻先」と「実質破綻先」に対する債権を「破産更生債権及びこれらに準ずる債権」、「破綻懸念先」に対する債権を「危険債権」、要注意先に対する貸出金のうち一定要件に該当する「3ヵ月以上延滞債権」と「貸出条件緩和債権」を「要管理債権」として開示しております。

なお、上記債権は取立不能見込額につき、部分直接償却相当額を直接減額した後の残高を記載しております。

3. 平成15年3月末における金融再生法開示債権は、3,800億円程度となる見込みであります。

#### 2. 自己資本比率

		(参考)
		平成14年9月末 (実績・国内基準)
	平成15年3月末 (予想値・国際統一基準)	
連結自己資本比率	10%程度	10.10%
連結Tier 比率	5%台半ば	5.05%

- (注) 1. 上記予想値は、経営環境に関する前提条件の変化等に伴い変動することがあります。  
2. 当社は平成15年3月12日をもって、みずほ信託銀行株式会社との合併を予定しており、平成15年3月末(予想値)は合併後の数値を記載しております。なお、本合併により国内基準から国際統一基準に変更となる予定であります。(本合併については、国内外当局による許認可と株主総会による承認等を前提としております。)

### 3. 時価のある有価証券の評価差額（単体）

平成15年1月21日付開示資料「保有株式の抜本的な処理等による平成15年3月期決算の業績予想の修正について」に記載のとおり、平成15年3月期通期で株式等損益を1,150億円計上し、株式含み損の一掃を図ります。

	平成14年12月末				平成14年6月末				(参考) 平成14年9月末 (単位: 億円)			
	時価	評価差額			時価	評価差額			時価	評価差額		
		うち益	うち損			うち益	うち損			うち益	うち損	
その他有価証券	12,067	1,128	217	1,345	11,527	392	364	757	11,953	679	274	953
株式	3,877	1,163	168	1,332	4,763	373	331	704	4,229	721	220	941
債券	5,121	22	25	2	3,980	18	25	6	5,765	31	32	1
その他	3,068	12	23	11	2,783	38	7	46	1,958	10	20	10

- (注) 1. 時価は、株式については各四半期末前1カ月の市場価格の平均等に基づき、また、それ以外については各四半期末日における市場価格等に基づいて算定されております。
2. 平成14年12月末及び6月末の「評価差額」は、平成14年12月末及び6月末時点の帳簿価額（償却原価法適用前、減損処理前）と時価との差額を計上しております。なお、平成14年9月期における減損処理額は154億円であります。
3. 有価証券のほか、コマーシャル・ペーパーを含めております。
4. 満期保有目的の債券、時価のある子会社・関連会社株式は保有しておりません。

### 4. デリバティブ取引（単体）

#### (1) 金利関連取引

区分	種類	平成14年12月末			平成14年6月末			(参考) 平成14年9月末 (単位: 億円)		
		契約額等	時価	評価損益	契約額等	時価	評価損益	契約額等	時価	評価損益
取引所	金利先物	948	3	3	1,663	0	0	546	1	1
	金利オプション	59	0	0	238	0	0	-	-	-
店頭	金利スワップ	144,482	10	10	145,055	19	19	146,385	7	7
	その他	881	6	3	1,082	7	3	981	6	3
合計				18			23			5

- (注) 1. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引は、上記記載から除いております。
2. その他はスワップション、キャップ・フロアー取引であります。

#### (2) 通貨関連取引

区分	種類	平成14年12月末			平成14年6月末			(参考) 平成14年9月末 (単位: 億円)		
		契約額等	時価	評価損益	契約額等	時価	評価損益	契約額等	時価	評価損益
店頭	通貨スワップ	2,357	0	0	2,729	0	0	2,497	0	0

- (注) 1. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引及び下記注2.の取引は、上記記載から除いております。
2. 期間損益計算を行なっている通貨スワップ取引の契約額等は、下記のとおりであります。

種類	平成14年12月末			平成14年6月末			(参考) 平成14年9月末 (単位: 億円)		
	契約額等	時価	評価損益	契約額等	時価	評価損益	契約額等	時価	評価損益
通貨スワップ	1,171	3	3	1,344	3	3	1,259	2	2

また、先物為替予約、通貨オプション等のうち、引直しを行なっている通貨関連のデリバティブ取引の契約額等は、下記のとおりであります。

区分	種類	平成14年12月末	平成14年6月末	(参考) 平成14年9月末 (単位: 億円)	
		契約額等	契約額等	契約額等	契約額等
店頭	為替予約	1,527	1,592	2,429	
	通貨オプション	421	654	570	

(3) 株式関連取引  
該当ありません。

(4) 債券関連取引

(参考) (単位：億円)

区分	種類	平成14年12月末			平成14年6月末			平成14年9月末		
		契約額等	時価	評価損益	契約額等	時価	評価損益	契約額等	時価	評価損益
取引所	債券先物	297	0	0	730	4	4	190	1	1
	債券先物 オプション	170	0	0	745	2	0	-	-	-
店頭	債券店頭 オプション	889	1	0	855	1	0	-	-	-
合計				0			3			1

(注) ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引は、該当ありません。

(5) 商品関連取引  
該当ありません。

(6) クレジットデリバティブ取引  
該当ありません。

(7) ウエザーデリバティブ取引  
該当ありません。

#### 5. ヘッジ会計適用デリバティブ取引に係る繰延損益(単体)

(参考) (単位：億円)

平成14年12月末			平成14年9月末		
繰延利益	繰延損失	ネット繰延損益	繰延利益	繰延損失	ネット繰延損益
740	949	208	668	895	226

(注) ヘッジ会計を適用している全てのデリバティブ取引の合計であります。

以上