

DISCLOSURE 2016

中間期 ディスクロージャー誌

みずほフィナンシャルグループ



TCSB

資産管理サービス信託銀行

Trust & Custody Services Bank, Ltd.

会社概要 (平成28年12月31日現在)

設立日 平成13年1月22日
所在地 〒104-6228 東京都中央区晴海1丁目8番12号
 晴海トリトンスクエア タワーZ
 TEL 03-6220-4000
店舗数 1(本店のみ)
資本金 500億円
出資者(出資比率) 株式会社みずほフィナンシャルグループ 540千株(54%)
 第一生命保険株式会社 160千株(16%)
 朝日生命保険相互会社 100千株(10%)
 明治安田生命保険相互会社 90千株(9%)
 株式会社かんぽ生命保険 70千株(7%)
 富国生命保険相互会社 40千株(4%)

従業員数 653人(平成28年9月30日現在)
 *従業員数は、社外から受け入れた出向者を含んでいます。
 また、執行役員、嘱託を含んでいません。

主な業務内容
 1. 有価証券管理サービス
 信託サービス、国内カストディサービス、
 海外カストディサービス、
 確定拠出年金の資産管理サービス、
 マスタートラストサービス(情報統合サービス)
 2. 資産管理に係る各種付加価値サービス
 包括的有価証券管理アウトソーシングサービス、
 セキュリティーズ・レンディングサービス、
 事務受任サービス(資産運用会社モデル・バックオフィス
 事務、店頭デリバティブ取引の担保管理事務)

銀行代理店 該当なし
URL <http://www.tcsb.co.jp/>



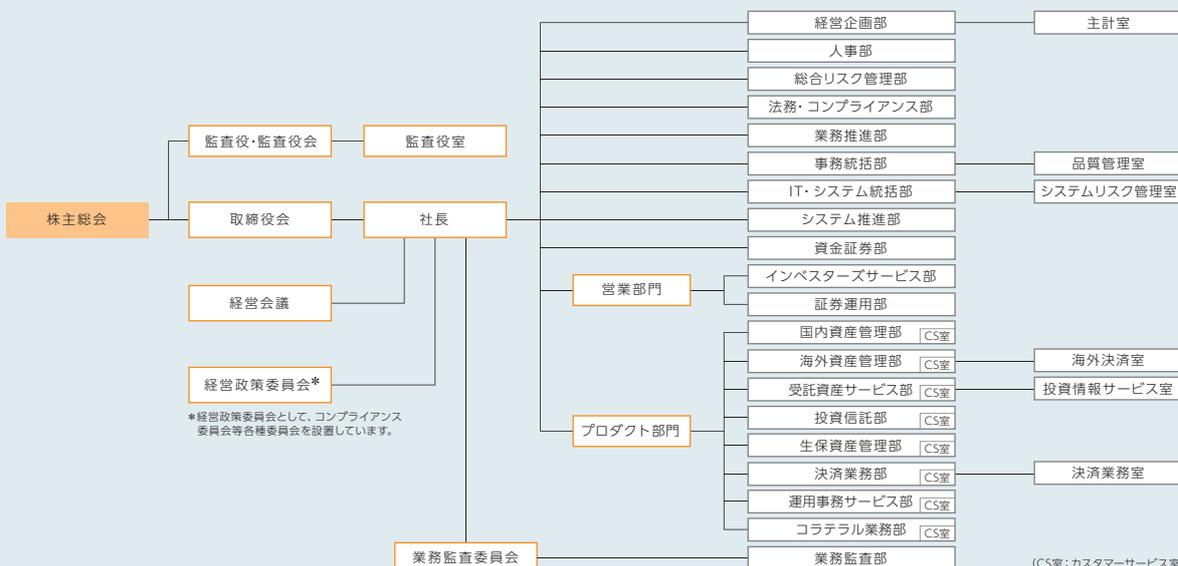
取得格付 (平成28年12月31日現在)

	長期	短期
S & P	A	A-1
Moody's	A1	Prime-1
R & I	AA-	a-1+

役員一覧 (平成28年12月31日現在)

代表取締役社長	森脇 朗	常勤監査役	仙仁 登
代表取締役副社長	宮田 芳文	常勤監査役	内野 寛人
専務取締役 営業部門長	高橋 敦	監査役	門口 真人
常務取締役	小幡 浩之	監査役	渡部 毅彦
取締役	渡辺 伸充	常務執行役員	斎藤 慎
取締役	藤原 弘治	常務執行役員	牧野 靖
取締役	藤岡 通浩	常務執行役員	吉田 昌史
取締役	植田 剛生	執行役員	富永 直彦
取締役	奈良 知明	執行役員	望月 稔

組織図 (平成28年12月31日現在)



*本誌は銀行法第21条に基づいて作成したディスクロージャー資料です。

CONTENTS

(平成28年度中間決算データ)

業績の概要	平成28年度中間期事業の概況……………	2
	主要な経営指標等の推移……………	2
財務諸表	中間貸借対照表……………	3
	中間損益計算書……………	3
	中間株主資本等変動計算書……………	4
	注記事項……………	5
	中間財務諸表に関する確認……………	7
損益の状況	業務粗利益……………	8
	資金運用・調達勘定の平均残高等……………	8
	受取利息・支払利息の増減……………	9
業務の状況	預金種類別平均残高……………	10
	貸出金科目別平均残高……………	10
	貸出金の残存期間別残高……………	10
	貸出金の担保別内訳……………	10
	債務の保証(支払承諾)残高……………	11
	貸出金の使途別残高……………	11
	貸出金の業種別残高……………	11
	中小企業等に対する貸出金残高……………	11
	リスク管理債権……………	11
	金融再生法施行規則に基づく開示債権の残高……………	11
	特定海外債権残高……………	11
	貸出金償却額……………	11
	貸倒引当金の残高及び増減額……………	11
	有価証券平均残高……………	11
	有価証券の残存期間別残高……………	12
	中小企業の経営の改善及び地域の活性化のための取組みの状況……………	12
時価情報等	有価証券及び金銭の信託の時価等……………	13
	デリバティブ取引の時価等……………	14
信託業務の状況	中間信託財産残高表……………	15
	元本補てん契約のある信託の期末受託残高……………	15
	金銭信託等の期末受託残高……………	16
	金銭信託等の信託期間別元本残高……………	16
	金銭信託等の運用状況……………	16
	金銭信託等に係る有価証券残高……………	16
	元本補てん契約のある信託の貸出金に係る破綻先債権・ 延滞債権・3ヶ月以上延滞債権・貸出条件緩和債権……………	16
	元本補てん契約のある信託の貸出金に係る 金融再生法施行規則に基づく開示債権の残高……………	16
経営諸指標	利益率……………	17
	資金利ざや……………	17
	預証率・預貸率……………	17
	自己資本の充実の状況等……………	17
連結情報	連結情報……………	20

※各資料は表記単位未満を切り捨てて表示しています。

業績の概要

平成28年度中間期事業の概況

【金融経済環境】

当中間期の経済情勢を顧みますと、世界経済は、全体としては緩やかな回復が続きましたが、一部には弱さもみられました。先行きは、米国を中心とした緩やかな回復が期待されますが、下振れリスクは残存しており、英国のEU離脱問題や各国でのテロなどの地政学的リスクの高まり、中国経済の動向などには注視を要する状況となっております。

日本経済は、輸出に持ち直しの動きがみられる一方、個人消費や設備投資が依然低調なことから、全体としては踊り場の状況が続きました。今後は、各種政策の効果もあり、緩やかな回復に向かうことが期待されますが、海外経済の不確実性の高まりや為替動向に留意する必要があります。

【事業の経過及び成果】

当社は、基本目標の「お客さまの資産運用高度化を支える資産管理のベストパートナー」にふさわしいサービス提供に向け、多様化・複雑化するお客さまニーズを適時・的確に把握するとともに、お客さまのニーズ・変化を先取りした商品・サービス戦略の立案、お客さまの「新しい取り組み」に対する迅速なソリューション開発に取り組んでまいりました。当中間期末における受託信託財産および常任代理契約等に基づく預り資産残高は当中間期中に約5兆円減少し、375兆円となりました。

当中間期の損益につきましては、経常収益はマイナス金利の影響による資金運用収益の減少を主因として前年同期比7億45百万円減少し、116億38百万円となりました。主な内訳は、役員取引等収益60億93百万円、信託報酬54億84百万円であります。

一方、経常費用は資金調達費用の減少を主因に前年同期比2億88百万円減少し、112億3百万円となりました。主な内訳は営業経費103億71百万円、役員取引等費用8億20百万円であります。

以上の結果、経常利益は4億35百万円（前年同期比4億56百万円減）、中間純利益は2億96百万円（同2億93百万円減）となりました。

主要な経営指標等の推移

	平成26年度 中間期	平成26年度	平成27年度 中間期	平成27年度	(単位：百万円) 平成28年度 中間期
経常収益	11,604	23,785	12,384	24,500	11,638
業務純益	866	1,825	892	1,735	448
経常利益	851	1,792	892	1,721	435
中間(当期)純利益	547	1,129	590	1,129	296
資本金	50,000	50,000	50,000	50,000	50,000
発行済株式総数	1,000千株	1,000千株	1,000千株	1,000千株	1,000千株
純資産額	58,854	59,419	59,783	60,385	60,506
総資産額	2,325,398	1,993,528	3,740,880	5,473,232	7,271,597
預金残高(含む譲渡性預金)	1,496,480	589,374	1,521,753	1,058,411	3,984,724
貸出金残高	—	100,000	70,000	210,496	876,006
有価証券残高	444,411	337,556	334,431	292,596	202,928
1株当たり純資産額(円)	58,854	59,419	59,783	60,385	60,506
1株当たり中間(年間)配当額(円)	—	230	—	230	—
1株当たり中間(当期)純利益額(円)	547.43	1,129.20	590.25	1,129.27	296.70
配当性向	—	20.36%	—	20.36%	—
従業員数(人)	588	603	619	631	653
単体自己資本比率(国内基準)(注)	40.31%	39.68%	40.82%	22.72%	20.81%
信託報酬	5,089	10,118	5,298	10,520	5,484
信託勘定貸出金残高	—	—	—	—	—
信託勘定有価証券残高	95,292,742	91,898,870	87,144,749	88,539,659	82,444,014
信託財産額	145,536,046	145,830,365	141,599,104	141,086,540	135,958,183

注. 「単体自己資本比率(国内基準)」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)に基づき算出しております。

財務諸表

中間貸借対照表

	平成27年度中間期 (平成27年9月30日)	平成28年度中間期 (平成28年9月30日)
(単位:百万円)		
資産の部		
現金預け金	3,111,897	5,263,645
コールローン	141,000	803,000
有価証券	334,431	202,928
貸出金	70,000	876,006
外国為替	1,149	1,576
その他資産	67,636	109,061
有形固定資産	577	651
無形固定資産	14,000	14,588
繰延税金資産	186	138
資産の部合計	3,740,880	7,271,597
負債及び純資産の部		
預金	80,449	3,484,724
譲渡性預金	1,441,304	500,000
コールマネー	1,223,858	243,500
信託勘定借	907,857	2,961,190
その他負債	27,384	21,399
賞与引当金	81	97
退職給付引当金	102	120
役員退職慰労引当金	60	57
負債の部合計	3,681,097	7,211,090
資本金	50,000	50,000
利益剰余金	9,770	10,375
利益準備金	275	321
その他利益剰余金	9,495	10,054
繰越利益剰余金	9,495	10,054
株主資本合計	59,770	60,375
その他有価証券評価差額金	12	130
評価・換算差額等合計	12	130
純資産の部合計	59,783	60,506
負債及び純資産の部合計	3,740,880	7,271,597

中間損益計算書

	平成27年度中間期 (平成27年4月1日から平成27年9月30日まで)	平成28年度中間期 (平成28年4月1日から平成28年9月30日まで)
(単位:百万円)		
経常収益	12,384	11,638
信託報酬	5,298	5,484
資金運用収益	1,107	58
(うち貸出金利息)	(47)	(2)
(うち有価証券利息配当金)	(179)	(118)
役務取引等収益	5,934	6,093
その他業務収益	32	1
その他経常収益	12	0
経常費用	11,491	11,203
資金調達費用	537	8
(うち預金利息)	(0)	(8)
役務取引等費用	905	820
その他業務費用	0	0
営業経費	10,046	10,371
その他経常費用	1	2
経常利益	892	435
特別損失	4	0
税引前中間純利益	887	434
法人税、住民税及び事業税	305	145
法人税等調整額	△ 8	△ 7
法人税等合計	297	138
中間純利益	590	296

財務諸表

中間株主資本等変動計算書

(単位：百万円)

	平成27年度中間期(平成27年4月1日から平成27年9月30日まで)							
	資本金	株主資本			株主資本 合計	評価・換算差額等		純資産 合計
		利益 準備金	利益剰余金 その他 利益剰余金 繰越 利益剰余金	利益剰余金 合計		その他 有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	50,000	229	9,180	9,409	59,409	9	9	59,419
当中間期変動額								
剰余金の配当		46	△ 276	△ 230	△ 230			△ 230
中間純利益			590	590	590			590
株主資本以外の項目の 当中間期変動額(純額)						3	3	3
当中間期変動額合計		46	314	360	360	3	3	363
当中間期末残高	50,000	275	9,495	9,770	59,770	12	12	59,783

(単位：百万円)

	平成28年度中間期(平成28年4月1日から平成28年9月30日まで)							
	資本金	株主資本			株主資本 合計	評価・換算差額等		純資産 合計
		利益 準備金	利益剰余金 その他 利益剰余金 繰越 利益剰余金	利益剰余金 合計		その他 有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	50,000	275	10,034	10,309	60,309	76	76	60,385
当中間期変動額								
剰余金の配当		46	△ 276	△ 230	△ 230			△ 230
中間純利益			296	296	296			296
株主資本以外の項目の 当中間期変動額(純額)						54	54	54
当中間期変動額合計		46	20	66	66	54	54	120
当中間期末残高	50,000	321	10,054	10,375	60,375	130	130	60,506

注記事項（平成28年度中間期）

重要な会計方針

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

有価証券の評価は、その他有価証券については原則として中間決算日の市場価格等に基づく時価法（売却原価は主として移動平均法により算定）、ただし時価を把握することが極めて困難と認められるものについては移動平均法による原価法により行っております。なお、その他有価証券の評価差額については、全部純資産直入法により処理しております。
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法

デリバティブ取引の評価は、時価法により行っております。
3. 固定資産の減価償却の方法
 - (1) 有形固定資産（リース資産を除く）

有形固定資産は、定率法（ただし、建物（建物附属設備を除く。）並びに平成28年4月1日以後に取得した建物附属設備及び構築物については定額法）を採用し、年間減価償却費見積額を期間により按分し計上しております。また、主な耐用年数は次のとおりであります。

建 物	6年～50年
その他	3年～20年
 - (2) 無形固定資産（リース資産を除く）

無形固定資産は、定額法により償却しております。なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間（主として5年）に基づいて償却しております。
4. 引当金の計上基準
 - (1) 貸倒引当金

貸倒引当金は、予め定めている償却・引当基準に則り、次のとおり計上しております。

「銀行等金融機関の資産の自己査定並びに貸倒償却及び貸倒引当金の監査に関する実務指針」（日本公認会計士協会銀行等監査特別委員会報告第4号 平成24年7月4日）に規定する正常先償権及び要注意先償権に相当する償権については、一定の種類毎に分類し、過去の一定期間における各々の貸倒実績から算出した貸倒実績率等に基づき計上しております。

すべての償権は、資産の自己査定基準に基づき、営業関連部署の協力の下に資産査定部署が資産査定を実施しております。ただし、当中間期末における貸倒引当金の残高はありません。
 - (2) 賞与引当金

賞与引当金は、従業員への賞与の支払いに備えるため、従業員に対する賞与の支給見込額のうち、当中間期に帰属する額を計上しております。
 - (3) 退職給付引当金

退職給付引当金は、従業員（執行役員を含む）の退職給付に備えるため、当期末における退職給付債務の見込額に基づき、当中間期末において発生していると認められる額を計上しております。
 - (4) 役員退職慰労引当金

役員退職慰労引当金は、役員への退職慰労金の支払いに備えるため、役員に対する退職慰労金の支給見積額のうち、当中間期末までに発生していると認められる額を計上しております。
5. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

外貨建資産・負債は、主として中間決算日の為替相場による円換算額を付しております。
6. 消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっております。

会計方針の変更

（「平成28年度税制改正に係る減価償却方法の変更に関する実務上の取扱い」の適用）

法人税法の改正に伴い、「平成28年度税制改正に係る減価償却方法の変更に関する実務上の取扱い」（実務対応報告第32号 平成28年6月17日）を当中間期に適用し、平成28年4月1日以後に取得した建物附属設備及び構築物に係る減価償却方法を定率法から定額法に変更しております。

この結果、当中間期の経常利益及び税引前中間純利益はそれぞれ0百万円増加しております。

注記事項

（中間貸借対照表関係）

1. 担保に供している資産は次のとおりであります。

担保に供している資産	
有価証券	155,466百万円
貸出金	876,006百万円

担保資産に対応する債務

当中間期末における対応する債務の残高はありません。

上記のほか、為替決済等の取引の担保として、有価証券29,988百万円を差し入れております。

また、その他の資産には、中央清算機関差入証拠金は88,348百万円、中央清算機関差入保証金は15,700百万円、先物取引差入証拠金は125百万円、保証金は659百万円が含まれております。
2. 当座貸越契約は、顧客からの融資実行の申し出を受けた場合に、契約上規定された条件について違反がない限り、一定の限度額まで資金を貸し付けることを約する契約であります。これらの契約に係る融資未実行残高は、2,283,600百万円であり、その全額が契約残存期間が1年以内のものであります。

なお、これらの契約の多くは、融資実行されずに終了するものであるため、融資未実行残高そのものが必ずしも当社の将来のキャッシュ・フローに影響を与えるものではありません。これらの契約の多くには、金融情勢の変化、債権の保全及びその他相当の事由があるときは、当社が実行申し込みを受けた融資の拒絶又は契約極度額の減額をすることができる旨の条項が付けられております。また、契約時において必要に応じて不動産・有価証券等の担保を徴求するほか、契約後も定期的に予め定めている社内手続に基づき顧客の業況等を把握し、必要に応じて契約の見直し、与信保全上の措置等を講じております。
3. 有形固定資産の減価償却累計額 1,416百万円
4. 元本補てん契約のある信託の元本金額は、金銭信託345,493百万円であります。

財務諸表

（中間株主資本等変動計算書関係）

1. 発行済株式の種類及び株式数に関する事項

（単位：千株）

	当事業年度期首株式数	当中間会計期間増加株式数	当中間会計期間減少株式数	当中間会計期間末株式数	摘要
発行済株式					
普通株式	1,000	—	—	1,000	
合計	1,000	—	—	1,000	

2. 配当に関する事項

当中間会計期間中の配当金支払額

（決議）	株式の種類	配当金の総額	1株当たり配当額	基準日	効力発生日
平成28年6月16日 定時株主総会	普通株式	230百万円	230円	平成28年3月31日	平成28年6月17日

（金融商品関係）

1. 金融商品の時価等に関する事項

平成28年9月30日における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額は、次のとおりであります。

なお、時価を把握することが極めて困難と認められる非上場株式等は、次表には含めておりません（注2）参照。

（単位：百万円）

	中間貸借対照表計上額	時価	差額
(1) 現金預け金	5,263,645	5,263,624	△ 21
(2) コールローン	803,000	803,000	—
(3) 有価証券			
その他有価証券	202,482	202,482	—
(4) 貸出金	876,006	875,892	△ 113
資産計	7,145,134	7,144,999	△ 134
(1) 預金	3,484,724	3,484,724	—
(2) 譲渡性預金	500,000	500,000	—
(3) コールマネー	243,500	243,500	—
(4) 信託勘定借	2,961,190	2,961,190	—
負債計	7,189,414	7,189,414	—
デリバティブ取引（*1）			
(1) ヘッジ会計が適用されていないもの	—	—	—
デリバティブ取引計	—	—	—

（*1） その他資産・負債に計上しているデリバティブ取引を一括して表示しております。デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しております。

（注1）金融商品の時価の算定方法

資産

(1) 現金預け金

満期のない預け金については、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。満期のある預け金については、一定の期間ごとに区分して、将来のキャッシュ・フローを割引いて現在価値を算定しております。その割引率は、市場金利を用いております。なお、残存期間が短期間（6ヶ月以内）のものは、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。

(2) コールローン

残存期間が短期間（6ヶ月以内）であり、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。

(3) 有価証券

債券は取引所の価格によっております。なお、有価証券に関する注記事項については「（有価証券関係）」に記載しております。

(4) 貸出金

貸出金は、その全額が日本国政府向けであることを考慮し、一定の期間ごとに区分して、将来キャッシュ・フローを割引いて現在価値を算定しております。なお、残存期間が短期間（6ヶ月以内）のものは、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。

負債

(1) 預金

要求払預金については、中間決算日に要求された場合の支払額（帳簿価額）を時価とみなしております。

(2) 譲渡性預金

残存期間が短期間（6ヶ月以内）であり、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。

(3) コールマネー

残存期間が短期間（6ヶ月以内）であり、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。

(4) 信託勘定借

中間決算日に要求された場合の支払額（帳簿価額）を時価とみなしております。

デリバティブ取引

デリバティブ取引は、金利関連取引（金利先物）であり、取引所の価格によっております。

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品の中間貸借対照表計上額は次のとおりであり、金融商品の時価情報の「資産(3) その他有価証券」には含まれておりません。

(単位：百万円)

区分	中間貸借対照表計上額
非上場株式(*1)	446
合計	446

(*1)非上場株式については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから時価開示の対象とはしておりません。

(有価証券関係)

中間貸借対照表の「有価証券」のほか、「現金預け金」中の譲渡性預け金が含まれております。

1. その他有価証券(平成28年9月30日現在)

(単位：百万円)

	種類	中間貸借対照表計上額	取得原価	差額
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの	債券			
	社債	199,679	199,490	188
	小計	199,679	199,490	188
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	債券			
	社債	2,802	2,803	△ 0
	その他	107,000	107,000	—
	小計	109,802	109,803	△ 0
合計		309,482	309,293	188

(注)時価を把握することが極めて困難と認められるその他有価証券

(単位：百万円)

	中間貸借対照表計上額
株式	442
その他	3
合計	446

これらについては、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

(税効果会計関係)

繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳は、それぞれ次のとおりであります。

(単位：百万円)

繰延税金資産	
未払事業税及び未払事業所税	60
退職給付引当金及び役員退職慰労引当金	54
資産除去債務	45
賞与引当金	34
無形固定資産	4
その他有価証券評価差額金	0
その他	22
繰延税金資産合計	222
繰延税金負債	
その他有価証券評価差額金	57
有形固定資産	23
その他	3
繰延税金負債合計	84
繰延税金資産の純額	138

(1株当たり情報)

1株当たりの純資産額 60,506円37銭

1株当たりの中間純利益金額 296円70銭

中間財務諸表に関する確認

私は、当社の平成28年4月1日から平成28年9月30日までの第17期中間事業年度に係る中間財務諸表(中間貸借対照表、中間損益計算書及び中間株主資本等変動計算書)が適正に表示されていること、ならびに、これらの中間財務諸表の作成に係る内部監査が有効に機能していることを確認いたしました。

平成29年1月18日

資産管理サービス信託銀行株式会社

代表取締役社長 森 脇 朗

損益の状況

損益の状況／業務粗利益
資金運用・調達勘定の平均残高等

業務粗利益

	平成27年度中間期			平成28年度中間期		
	国内業務部門	国際業務部門	合計	国内業務部門	国際業務部門	合計
	(単位:百万円)					
信託報酬	5,298	—	5,298	5,484	—	5,484
資金運用収支	566	3	569	49	0	49
資金運用収益	(—)	(2)		(—)	(△ 0)	
資金調達費用	1,105	4	1,107	58	0	58
	(2)	(—)		(△ 0)	(—)	
	539	1	537	8	0	8
役務取引等収支	5,468	△ 439	5,028	5,678	△ 405	5,272
役務取引等収益	5,858	75	5,934	6,023	69	6,093
役務取引等費用	390	515	905	345	475	820
特定取引収支	—	—	—	—	—	—
その他業務収支	△ 0	32	31	△ 0	1	1
その他業務収益	—	32	32	—	1	1
その他業務費用	0	—	0	0	—	0
業務粗利益	11,331	△ 404	10,927	11,212	△ 404	10,808
業務粗利益率	1.15%	△ 7.57%	1.11%	0.39%	△ 11.55%	0.38%

注1. 国内業務は円建取引、国際業務は外貨建取引です。ただし、円建対非居住者取引などは国際業務に含めております。
 2. 資金運用収益および資金調達費用の上段の数値は、国内業務部門と国際業務部門の間の資金貸借の利息であります。
 3. 業務粗利益率=業務粗利益÷資金運用勘定平均残高×100×365/183

資金運用・調達勘定の平均残高等

	平成27年度中間期			平成28年度中間期		
	平均残高	利息	利回り	平均残高	利息	利回り
	(単位:百万円)					
〈国内業務部門〉						
資金運用勘定	(—)	(—)		(—)	(—)	
	1,952,396	1,105	0.11%	5,601,357	58	0.00%
うち貸出金	112,896	47	0.08%	500,714	2	0.00%
有価証券	346,489	179	0.10%	237,447	118	0.09%
コールローン	173,847	153	0.17%	2,241,815	△ 256	△ 0.02%
預け金	1,319,162	726	0.10%	2,621,380	193	0.01%
資金調達勘定	(9,817)	(2)		(6,842)	(△ 0)	
	1,988,961	539	0.05%	5,753,367	8	0.00%
うち預金	128,216	0	0.00%	1,781,838	8	0.00%
譲渡性預金	835,231	209	0.04%	500,000	2	0.00%
コールマネー	762,014	285	0.07%	270,723	△ 12	△ 0.00%
借入金	—	—	—	—	—	—
〈国際業務部門〉						
資金運用勘定	(9,817)	(2)		(6,842)	(△ 0)	
	10,653	4	0.07%	6,974	0	0.01%
うち貸出金	—	—	—	—	—	—
有価証券	4	—	—	4	—	—
コールローン	—	—	—	—	—	—
預け金	—	—	—	—	—	—
資金調達勘定	(—)	(—)		(—)	(—)	
	4,686	1	0.04%	908	0	0.04%
うち預金	—	—	—	—	—	—
譲渡性預金	—	—	—	—	—	—
コールマネー	—	—	—	—	—	—
借入金	—	—	—	—	—	—
〈合計〉						
資金運用勘定	1,953,232	1,107	0.11%	5,601,489	58	0.00%
うち貸出金	112,896	47	0.08%	500,714	2	0.00%
有価証券	346,494	179	0.10%	237,451	118	0.09%
コールローン	173,847	153	0.17%	2,241,815	△ 256	△ 0.02%
預け金	1,319,162	726	0.10%	2,621,380	193	0.01%
資金調達勘定	1,983,829	537	0.05%	5,747,433	8	0.00%
うち預金	128,216	0	0.00%	1,781,838	8	0.00%
譲渡性預金	835,231	209	0.04%	500,000	2	0.00%
コールマネー	762,014	285	0.07%	270,723	△ 12	△ 0.00%
借入金	—	—	—	—	—	—

注1. 資金運用勘定は無利息預け金の平均残高(平成27年度中間期1,013百万円、平成28年度中間期15百万円)を控除して表示しております。
 2. ()内は国内業務部門と国際業務部門の間の資金貸借の平均残高および利息であります。

受取利息・支払利息の増減

	平成27年度中間期			平成28年度中間期		
	残高による増減	利率による増減	純増減	残高による増減	利率による増減	純増減
(単位:百万円)						
〈国内業務部門〉						
受取利息	348	△ 73	274	38	△ 1,085	△ 1,047
うち貸出金	44	△ 0	44	1	△ 46	△ 44
有価証券	△ 3	△ 13	△ 16	△ 56	△ 4	△ 60
コールローン	△ 7	△ 18	△ 26	△ 236	△ 173	△ 409
預け金	287	△ 14	272	96	△ 628	△ 532
支払利息	176	0	176	5	△ 536	△ 531
うち預金	0	△ 0	0	7	△ 0	7
譲渡性預金	53	0	53	△ 2	△ 204	△ 206
コールマネー	110	△ 1	109	70	△ 368	△ 297
借入金	△ 0	—	△ 0	—	—	—
〈国際業務部門〉						
受取利息	0	0	0	△ 0	△ 3	△ 3
うち貸出金	—	—	—	—	—	—
有価証券	—	—	—	—	—	—
コールローン	—	—	—	—	—	—
預け金	—	—	—	—	—	—
支払利息	0	△ 0	0	△ 0	△ 0	△ 0
うち預金	—	—	—	—	—	—
譲渡性預金	—	—	—	—	—	—
コールマネー	—	—	—	—	—	—
借入金	—	—	—	—	—	—
〈合計〉						
受取利息	348	△ 74	274	38	△ 1,086	△ 1,048
うち貸出金	44	△ 0	44	1	△ 46	△ 44
有価証券	△ 3	△ 13	△ 16	△ 56	△ 4	△ 60
コールローン	△ 7	△ 18	△ 26	△ 236	△ 173	△ 409
預け金	287	△ 14	272	96	△ 628	△ 532
支払利息	176	△ 0	176	5	△ 534	△ 529
うち預金	0	△ 0	0	7	△ 0	7
譲渡性預金	53	0	53	△ 2	△ 204	△ 206
コールマネー	110	△ 1	109	70	△ 368	△ 297
借入金	△ 0	—	△ 0	—	—	—

注. 残高および利率の増減要因が重なる部分については、両者の増減割合に応じて按分しております。

業務の状況

業務の状況／預金種類別平均残高
貸出金科目別平均残高
貸出金の残存期間別残高
貸出金の担保別内訳

預金種類別平均残高

	平成27年度中間期	平成28年度中間期
	(単位:百万円)	
〈国内業務部門〉		
預金	128,216	1,781,838
流動性預金	64,805	1,730,112
定期性預金	—	—
その他の預金	63,411	51,726
譲渡性預金	835,231	500,000
〈国際業務部門〉		
預金	—	—
流動性預金	—	—
定期性預金	—	—
その他の預金	—	—
譲渡性預金	—	—
〈合計〉		
預金	128,216	1,781,838
流動性預金	64,805	1,730,112
定期性預金	—	—
その他の預金	63,411	51,726
譲渡性預金	835,231	500,000

注1. 流動性預金=当座預金+普通預金+貯蓄預金+通知預金

2. 定期性預金=定期預金

貸出金科目別平均残高

	平成27年度中間期	平成28年度中間期
	(単位:百万円)	
〈国内業務部門〉		
手形貸付	—	—
証書貸付	112,896	500,714
当座貸越	—	—
割引手形	—	—
合計	112,896	500,714
〈国際業務部門〉		
手形貸付	—	—
証書貸付	—	—
当座貸越	—	—
割引手形	—	—
合計	—	—
〈合計〉		
手形貸付	—	—
証書貸付	112,896	500,714
当座貸越	—	—
割引手形	—	—
合計	112,896	500,714

貸出金の残存期間別残高

	平成27年度中間期	平成28年度中間期
	(単位:百万円)	
1年以下	70,000	876,006
うち変動金利	—	—
固定金利	70,000	876,006
合計	70,000	876,006
うち変動金利	—	—
固定金利	70,000	876,006

貸出金の担保別内訳

	平成27年度中間期	平成28年度中間期
	(単位:百万円)	
有価証券	—	—
債権	—	—
商品	—	—
不動産	—	—
保証	—	—
信用	70,000	876,006
合計	70,000	876,006

債務の保証（支払承諾）残高 該当ありません

貸出金の使途別残高

	平成27年度中間期	平成28年度中間期
設備資金	—	—
運転資金	70,000	876,006
合計	70,000	876,006

(単位：百万円)

貸出金の業種別残高

	平成27年度中間期		平成28年度中間期	
	残高	構成比	残高	構成比
政府等	70,000	100.00	876,006	100.00
合計	70,000	100.00	876,006	100.00

(単位：百万円、%)

中小企業等に対する貸出金残高 該当ありません

リスク管理債権（破綻先債権・延滞債権・3ヶ月以上延滞債権・貸出条件緩和債権額の状況）

該当ありません

金融再生法施行規則に基づく開示債権の残高

	平成27年度中間期	平成28年度中間期
正常債権	70,026	876,007
合計	70,026	876,007

(単位：百万円)

注. 破産更生債権及びこれらに準ずる債権、危険債権、要管理債権の該当はありません。

特定海外債権残高／貸出金償却額／貸倒引当金の残高及び増減額 該当ありません

有価証券平均残高

	平成27年度中間期	平成28年度中間期
〈国内業務部門〉		
国債	125,300	4,849
地方債	—	—
短期社債	—	—
社債	220,747	232,156
株式	442	442
その他の証券	—	—
合計	346,489	237,447
〈国際業務部門〉		
国債	—	—
地方債	—	—
短期社債	—	—
社債	—	—
株式	—	—
その他の証券	4	4
うち外国株式	4	4
うち外国債券	—	—
合計	4	4
〈合計〉		
国債	125,300	4,849
地方債	—	—
短期社債	—	—
社債	220,747	232,156
株式	442	442
その他の証券	4	4
うち外国株式	4	4
うち外国債券	—	—
合計	346,494	237,451

(単位：百万円)

業務の状況

有価証券の残存期間別残高

	平成27年度中間期	平成28年度中間期
(単位:百万円)		
国債		
1年以下	102,031	—
1年超3年以下	—	—
3年超5年以下	—	—
5年超7年以下	—	—
7年超10年以下	—	—
10年超	—	—
合計	102,031	—
地方債		
合計	—	—
短期社債		
1年以下	—	—
合計	—	—
社債		
1年以下	129,538	124,360
1年超3年以下	102,413	78,122
3年超5年以下	—	—
5年超7年以下	—	—
7年超10年以下	—	—
合計	231,952	202,482
株式		
期間の定めのないもの	442	442
合計	442	442
その他の証券		
期間の定めのないもの	4	3
合計	4	3
うち外国株式		
期間の定めのないもの	4	3
計	4	3
うち外国債券		
計	—	—

中小企業の経営の改善及び地域の活性化のための取組みの状況

当社は、「資産管理業務を戦略的なプロダクトへ、そして資産管理に係る総合的なサービスに発展させる」という理念に基づき、資産管理専門信託銀行としてお客さまの資産管理に関する業務に特化したサービスを行っております。そうした業務上の特性から、現状、中小企業のお客さまを含む企業向けの事業資金の貸付および住宅ローンのご利用を希望されるお客さまへの貸付はお取り扱いをしておりません。そのため、中小企業の経営の改善及び地域の活性化のための直接的な取組みは行っておりません。

有価証券及び金銭の信託の時価等

有価証券

中間貸借対照表の「有価証券」のほか、「現金預け金」中の譲渡性預け金を含めて記載しております。

その他有価証券

種類	平成27年度中間期			平成28年度中間期		
	中間貸借対照表計上額	取得原価	差額	中間貸借対照表計上額	取得原価	差額
(単位：百万円)						
債券						
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの	国債	102,031	102,005	25	—	—
	社債	76,081	76,070	10	199,679	199,490
	小計	178,112	178,076	36	199,679	199,490
債券						
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	社債	155,871	155,888	△ 17	2,802	2,803
	その他	120,000	120,000	—	107,000	107,000
	小計	275,871	275,888	△ 17	109,802	109,803
合計	453,984	453,965	18	309,482	309,293	188

注. 中間貸借対照表計上額は各中間期末日における取引所の価格に基づく時価により計上したものであります。

金銭の信託 該当ありません

その他有価証券評価差額金

	平成27年度中間期	平成28年度中間期
評価差額	19	188
その他有価証券	19	188
繰延税金資産(△は繰延税金負債)	△ 6	△ 57
その他有価証券評価差額金	12	130

時価情報等

デリバティブ取引の時価等

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引について、取引の対象物の種類ごとの中間決算日における契約額又は契約において定められた元本相当額、時価及び評価損益並びに当該時価の算定方法は、次のとおりであります。なお、契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

(1) 金利関連取引

区分	種類	平成27年度中間期				平成28年度中間期			
		契約額等	契約額等のうち 1年超のもの	時価	評価損益	契約額等	契約額等のうち 1年超のもの	時価	評価損益
取 引 融 資 品	金利先物								
	売建	—	—	—	—	100,000	—	—	—
	買建	—	—	—	—	—	—	—	—
	合計	/	/	—	—	/	/	—	—

注1. 上記取引については時価評価を行い、評価損益を中間損益計算書に計上しております。
2. 時価は東京金融取引所の価格によって算定しております。

(2) 通貨関連取引

区分	種類	平成27年度中間期				平成28年度中間期			
		契約額等	契約額等のうち 1年超のもの	時価	評価損益	契約額等	契約額等のうち 1年超のもの	時価	評価損益
店 頭	為替予約								
	売建	3,982	—	△ 3	△ 3	—	—	—	—
	買建	7,953	—	12	12	—	—	—	—
	合計	/	/	8	8	/	/	—	—

注1. 上記取引については時価評価を行い、評価損益を中間損益計算書に計上しております。
2. 時価は先物為替相場によって算定しております。

(3) 株式関連取引、債券関連取引、商品関連取引、その他のデリバティブ取引 該当ありません

信託業務の状況

信託業務の状況 / 中間信託財産残高表 — 元本補てん契約のある信託の期末受託残高

中間信託財産残高表

	平成27年度中間期 (平成27年9月30日)	平成28年度中間期 (平成28年9月30日)
(単位:百万円)		
(資産)		
有価証券	87,144,749	82,444,014
国債	51,735,153	47,704,113
地方債	4,564,089	4,413,654
短期社債	377,433	271,999
社債	10,634,651	9,712,953
株式	10,007,309	9,902,446
外国証券	8,745,850	9,221,376
その他の証券	1,080,261	1,217,471
投資信託外国投資	6,541,133	6,327,075
信託受益権	17,460,534	17,357,665
受託有価証券	5,773,689	5,815,937
金銭債権	655,150	697,217
生命保険債権	358,056	385,501
その他の金銭債権	297,094	311,716
その他債権	10,695,942	11,110,687
コールローン	5,036,168	868,466
銀行勘定貸	907,857	2,961,190
現金預け金	7,383,878	8,375,927
預け金	7,383,878	8,375,927
資産合計	141,599,104	135,958,183
(負債)		
指定金銭信託	159	95
特定金銭信託	64,889,222	60,199,035
投資信託	85,160	11,775
金銭信託以外の金銭の信託	43,694	235,910
有価証券の信託	9,834,239	9,962,476
包括信託	66,746,628	65,548,889
負債合計	141,599,104	135,958,183

元本補てん契約のある信託の期末受託残高 (信託財産の運用のため再信託された信託を含む)

金銭信託

	平成27年度中間期	平成28年度中間期
(単位:百万円)		
(資産)		
その他	165	345,493
資産合計	165	345,493
(負債)		
元本	165	345,493
その他	0	0
負債合計	165	345,493

信託業務の状況

金銭信託等の期末受託残高

	平成27年度中間期	平成28年度中間期
金銭信託	64,889,382	60,199,131

(単位：百万円)

金銭信託等の信託期間別元本残高

	平成27年度中間期	平成28年度中間期
金銭信託		
1年未満	—	—
1年以上2年未満	58,037,801	56,217,348
2年以上5年未満	—	—
5年以上	524,263	593,794
その他のもの	165	345,493
合計	58,562,230	57,156,637

(単位：百万円)

金銭信託等の運用状況

	平成27年度中間期	平成28年度中間期
金銭信託		
貸出金	—	—
有価証券	53,652,819	48,781,471

(単位：百万円)

金銭信託等に係る有価証券残高

	平成27年度中間期	平成28年度中間期
国債	42,273,232	38,584,618
地方債	2,644,763	2,458,139
社債	6,581,011	5,771,026
株式	811,736	867,418
その他の証券	1,342,074	1,100,267
合計	53,652,819	48,781,471

(単位：百万円)

元本補てん契約のある信託の貸出金に係る破綻先債権・延滞債権・3ヶ月以上延滞債権・貸出条件緩和債権
該当ありません

元本補てん契約のある信託の貸出金に係る金融再生法施行規則に基づく開示債権の残高
該当ありません

利益率

	平成27年度中間期	平成28年度中間期
総資産経常利益率	0.08	0.01
自己資本経常利益率	3.57	1.71
総資産中間純利益率	0.05	0.01
自己資本中間純利益率	2.36	1.16

注1. 総資産経常(中間純)利益率=経常(中間純)利益÷総資産(除く支払承諾見返)平均残高×100×365/183
 2. 自己資本経常(中間純)利益率=経常(中間純)利益÷株主資本及び評価・換算差額等平均残高×100×365/183

資金利ざや

	平成27年度中間期			平成28年度中間期		
	国内業務部門	国際業務部門	合計	国内業務部門	国際業務部門	合計
資金運用利回り	0.11	0.07	0.11	0.00	0.01	0.00
資金調達利回り	0.05	0.04	0.05	0.00	0.04	0.00
資金粗利ざや	0.05	0.02	0.05	0.00	△ 0.03	0.00

預証率・預貸率

	平成27年度中間期			平成28年度中間期		
	国内業務部門	国際業務部門	合計	国内業務部門	国際業務部門	合計
預証率						
期末	21.97	—	21.97	5.09	—	5.09
期中平均	35.96	—	35.96	10.40	—	10.40
預貸率						
期末	4.59	—	4.59	21.98	—	21.98
期中平均	11.71	—	11.71	21.94	—	21.94

注. 預金には譲渡性預金を含んでおります。

自己資本の充実の状況等

本項目は、銀行法施行規則(昭和57年大蔵省令第10号)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)について開示するものです。

● 自己資本の構成に関する開示事項

単体自己資本比率総括表〈国内基準〉

コア資本に係る基礎項目 (1)	平成27年度中間期	平成28年度中間期
	経過措置による不算入額	経過措置による不算入額
普通株式又は強制転換条項付優先株式に係る株主資本の額	59,770	60,375
うち、資本金及び資本剰余金の額	50,000	50,000
うち、利益剰余金の額	9,770	10,375
うち、自己株式の額(△)	—	—
うち、社外流出予定額(△)	—	—
うち、上記以外に該当するものの額	—	—
普通株式又は強制転換条項付優先株式に係る新株予約権の額	—	—

経営諸指標

経営諸指標／自己資本の充実の状況等

	平成27年度中間期		平成28年度中間期	
		経過措置による 不算入額		経過措置による 不算入額
	(単位:百万円)			
コア資本に係る基礎項目の額に算入される引当金の合計額	—	—	—	—
うち、一般貸倒引当金コア資本算入額	—	—	—	—
うち、適格引当金コア資本算入額	—	—	—	—
適格旧非累積的永久優先株の額のうち、コア資本に係る基礎項目の額に含まれる額	—	—	—	—
適格旧資本調達手段の額のうち、コア資本に係る基礎項目の額に含まれる額	—	—	—	—
公的機関による資本の増強に関する措置を通じて発行された資本調達手段の額のうち、コア資本に係る基礎項目の額に含まれる額	—	—	—	—
土地再評価額と再評価直前の帳簿価額の差額の45%に相当する額のうち、コア資本に係る基礎項目の額に含まれる額	—	—	—	—
コア資本に係る基礎項目の額 (イ)	59,770	—	60,375	—
コア資本に係る調整項目 (2)				
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	2,800	11,200	5,835	8,753
うち、のれんに係るものの額	—	—	—	—
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額	2,800	11,200	5,835	8,753
繰延税金資産(一時差異に係るものを除く。)の額	—	—	—	—
適格引当金不足額	—	—	—	—
証券化取引に伴い増加した自己資本に相当する額	—	—	—	—
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	—	—	—	—
前払年金費用の額	—	—	—	—
自己保有普通株式等(純資産の部に計上されるものを除く。)の額	—	—	—	—
意図的に保有している他の金融機関等の対象資本調達手段の額	—	—	—	—
少数出資金融機関等の対象普通株式等の額	—	—	—	—
特定項目に係る10%基準超過額	—	—	—	—
うち、その他金融機関等の対象普通株式等に該当するものに関連するものの額	—	—	—	—
うち、モーゲージ・サービシング・ライツに係る無形固定資産に関連するものの額	—	—	—	—
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	—	—	—	—
特定項目に係る15%基準超過額	—	—	—	—
うち、その他金融機関等の対象普通株式等に該当するものに関連するものの額	—	—	—	—
うち、モーゲージ・サービシング・ライツに係る無形固定資産に関連するものの額	—	—	—	—
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	—	—	—	—
コア資本に係る調整項目の額 (ロ)	2,800	—	5,835	—
自己資本				
自己資本の額((イ)-(ロ)) (ハ)	56,969	—	54,540	—
リスク・アセット等 (3)				
信用リスク・アセットの額の合計額	114,298	—	231,914	—
うち、経過措置によりリスク・アセットの額に算入される額の合計額	11,200	—	8,753	—
うち、無形固定資産(のれん及びモーゲージ・サービシング・ライツに係るものを除く。)	11,200	—	8,753	—
うち、繰延税金資産	—	—	—	—
うち、前払年金費用	—	—	—	—
うち、他の金融機関等向けエクスポージャー	—	—	—	—
うち、上記以外に該当するものの額	—	—	—	—
マーケット・リスク相当額の合計額を8%で除して得た額	—	—	—	—
オペレーショナル・リスク相当額の合計額を8%で除して得た額	25,244	—	30,110	—
信用リスク・アセット調整額	—	—	—	—
オペレーショナル・リスク相当額調整額	—	—	—	—
リスク・アセット等の額の合計額 (ニ)	139,542	—	262,025	—
自己資本比率				
自己資本比率((ハ)/(ニ))	40.82%	—	20.81%	—

● 自己資本

ポートフォリオ区分別単体所要自己資本額

	平成27年度中間期	平成28年度中間期
信用リスク	45.7	92.7
標準的手法	35.0	84.9
ソブリン向け	—	—
金融機関等向け	27.4	78.8
法人等向け	1.1	1.1
抵当権付住宅ローン	—	—
証券化	—	—
その他	6.5	4.8
CVAリスク	—	—
中央清算機関関連向け	10.6	7.8
オペレーショナル・リスク	10.0	12.0
単体総所要自己資本額	55.8	104.8

オペレーショナル・リスク相当額は、先進的計測手法を使用して算出しております。(基礎的手法・粗利益配分手法は使用していません。)

● 信用リスク

信用リスクに関するエクスポージャーの状況

注. オフバランスのエクスポージャーは与信相当額を記載しております。また、信用リスク・アセットの額の算出を要しないこととされているエクスポージャーは含めておりません。

なお、前中間期、当中間期とも、信用リスクに関するエクスポージャーの期末残高と期中の平均的なリスクポジションに大幅な乖離はみられません。

	平成27年度中間期					平成28年度中間期				
	貸出金・ コミットメント・ デリバティブ以外 のオフバランス	有価証券	デリバティブ	その他	合計	貸出金・ コミットメント・ デリバティブ以外 のオフバランス	有価証券	デリバティブ	その他	合計
〈地域別内訳〉										
国内	700	3,343	—	32,698	36,742	19,074	2,027	—	60,809	81,911
海外	—	0	—	12	12	—	0	—	16	16
合計	700	3,343	—	32,710	36,754	19,074	2,027	—	60,826	81,928
〈取引相手別内訳〉										
ソブリン向け	700	1,020	—	29,274	30,994	19,074	—	—	51,035	70,110
金融機関等向け	—	225	—	3,200	3,425	—	299	—	9,560	9,860
法人等向け	—	—	—	28	28	—	—	—	29	29
その他	—	2,098	—	206	2,305	—	1,727	—	200	1,927
合計	700	3,343	—	32,710	36,754	19,074	2,027	—	60,826	81,928
〈期間別内訳〉										
1年以内	700	2,315	—	32,496	35,511	19,074	1,242	—	60,617	80,935
1年超	—	1,024	—	—	1,024	—	780	—	—	780
その他	—	4	—	214	218	—	4	—	208	212
合計	700	3,343	—	32,710	36,754	19,074	2,027	—	60,826	81,928

延滞エクスポージャーの状況 該当ありません

貸倒引当金・貸出金償却の状況 該当ありません

標準的手法が適用されるエクスポージャーの状況

リスク・ウェイト区分別内訳（信用リスク削減効果適用後）

	平成27年度中間期			平成28年度中間期		
〈リスク・ウェイト〉	オンバランス	オフバランス	合計	オンバランス	オフバランス	合計
0%	32,810	—	32,810	61,441	10,314	71,756
10%	362	—	362	178	—	178
20%	3,425	—	3,425	9,860	—	9,860
35%	—	—	—	—	—	—
50%	—	—	—	—	—	—
100%	155	—	155	132	—	132
150%	—	—	—	—	—	—
350%	—	—	—	—	—	—
合計	36,754	—	36,754	71,613	10,314	81,928

資本控除の額/1,250%のリスク・ウェイトが適用されるエクスポージャーの額 該当ありません

● 信用リスク削減手法

信用リスク削減手法が適用されたエクスポージャーの内訳

	平成27年度中間期				平成28年度中間期			
	金融資産担保	保証	クレジット・デリバティブ	合計	金融資産担保	保証	クレジット・デリバティブ	合計
(単位: 億円)								
〈標準的手法〉								
ソブリン向け	—	—	—	—	—	—	—	—
金融機関等向け	—	—	—	—	—	—	—	—
法人等向け	—	—	—	—	—	—	—	—
抵当権付住宅ローン	—	—	—	—	—	—	—	—
証券化	—	—	—	—	—	—	—	—
その他	—	1,732	—	1,732	—	1,545	—	1,545
合計	—	1,732	—	1,732	—	1,545	—	1,545

● 派生商品取引及び長期決済期間取引の取引相手のリスク 該当ありません

● 証券化エクスポージャー 該当ありません

● マーケット・リスク 当社は自己資本比率の算出においてマーケット・リスク相当額を算入しておりません。

● 株式等エクスポージャーのリスク

株式等エクスポージャーの状況

	平成27年度中間期		平成28年度中間期	
	中間貸借対照表計上額	時価	中間貸借対照表計上額	時価
(単位: 億円)				
上場株式等エクスポージャー	—	—	—	—
上記以外の株式等エクスポージャー	4	—	4	—
合計	4	—	4	—

株式等エクスポージャーに係る売却損益、償却損、評価損益の該当はありません。

● 銀行勘定における金利リスク

アウトライヤー基準

「アウトライヤー基準」試算結果

	(単位: 億円)		
	損失額	広義自己資本	自己資本に対する割合
平成27年度中間期末基準	64	569	11.2%
平成28年度中間期末基準	94	545	17.3%

試算の前提: 標準的金利ショックは上下200ベース・ポイントの平行移動を想定しており、コア預金は定義しておりません。

連結情報

当社には子会社がないため、連結決算は実施しておりません。

開示項目索引

銀行法施行規則第19条の2

1. 概況及び組織に関する事項

○大株主一覧 表紙裏面

2. 主要な業務に関する事項

○直近の中間事業年度における事業の概況 2

○直近の3中間事業年度及び2事業年度における
主要な業務の状況を示す指標

・経常収益	2
・経常利益又は経常損失	2
・中間純利益又は中間純損失	2
・資本金及び発行済株式の総数	2
・純資産額	2
・総資産額	2
・預金残高	2
・貸出金残高	2
・有価証券残高	2
・単体自己資本比率	2
・従業員数	2
・信託報酬	2
・信託勘定貸出金残高	2
・信託勘定有価証券残高	2
・信託財産額	2

○直近の2中間事業年度における業務の状況を示す指標

(1) 主要な業務の状況を示す指標

・業務粗利益及び業務粗利益率	8
・資金運用収支、役員取引等収支、特定取引収支 及びその他業務収支	8
・資金運用勘定並びに資金調達勘定の平均残高、 利息、利回り及び資金利ざや	8、17
・受取利息及び支払利息の増減	9
・総資産経常利益率及び資本経常利益率	17
・総資産中間純利益率及び資本中間純利益率	17

(2) 預金に関する指標

・預金科目別平均残高	10
・定期預金の残存期間別残高	該当ありません

(3) 貸出金等に関する指標

・貸出金科目平均残高	10
・貸出金の残存期間別の残高	10
・担保の種類別の貸出金残高及び支払承認見返額	10、11
・使途別の貸出金残高	11
・業種別の貸出金残高及び貸出金の総額に占める割合	11
・中小企業等に対する貸出金残高及び 貸出金の総額に占める割合	該当ありません
・特定海外債権残高の5パーセント以上 を占める国別の残高	該当ありません
・預貸率の期末値及び期中平均値	17

(4) 有価証券に関する指標

・商品有価証券の種類別の平均残高	該当ありません
・有価証券の種類別の残存期間別の残高	12
・有価証券の種類別の平均残高	11
・預証率の期末値及び期中平均値	17

(5) 信託業務に関する指標

・信託財産残高表	15
・金銭信託等の受託残高	16
・元本補てん契約のある信託の種類別の受託残高	15
・信託期間別の金銭信託及び貸付信託の元本残高	16
・金銭信託等の種類別の貸出金及び有価証券の 区分ごとの運用残高	16
・金銭信託等に係る貸出金の 科目別の残高	該当ありません
・金銭信託等に係る貸出金の 契約期間別の残高	該当ありません
・担保の種類別の金銭信託等に係る 貸出金残高	該当ありません
・使途別の金銭信託等に係る貸出金残高	該当ありません
・業種別の金銭信託等に係る貸出金残高 及び貸出金の総額に占める割合	該当ありません
・中小企業等に対する金銭信託等に係る 貸出残高及び貸出金の総額に占める割合	該当ありません
・金銭信託等に係る有価証券の種類別の残高	16

3. 銀行の業務の運営に関する事項

○中小企業の経営の改善及び地域の活性化のための
取組の状況 12

4. 直近の2中間事業年度における財産の状況に 関する事項

○中間貸借対照表、中間損益計算書及び 中間株主資本等変動計算書	3、4
○リスク管理債権残高	該当ありません
○元本補てん契約のある信託のリスク管理 債権残高	該当ありません
○自己資本の充実の状況	17
○有価証券、金銭の信託、デリバティブ取引の 時価等情報	13、14
○貸倒引当金の期末残高及び期中の増減額	該当ありません
○貸出金償却の額	該当ありません
○金融商品取引法に基づく監査結果	該当ありません
○自己資本比率の算定に関する監査結果	該当ありません

平成26年金融庁告示第7号

1. 自己資本の充実の状況等 17

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

1. 資産査定状況 11

発行 平成29年1月 資産管理サービス信託銀行株式会社
〒104-6228 東京都中央区晴海1-8-12 晴海トリトンスクエア タワーZ
TEL 03-6220-4000 URL <http://www.tcsb.co.jp/>

みずほフィナンシャルグループ



資産管理サービス信託銀行

Trust & Custody Services Bank, Ltd.

TCSB