

平成13年3月期

決算短信(連結)

平成 13 年 5 月 25 日

上場会社名
コード番号

中央三井信託銀行株式会社
8408

上場取引所
本社所在都道府県

東証・大証・名証 各第一部
東京都

問合せ先
責任者役職名
氏名

総合企画部次長
橋本 勝

TEL (03)5232-8642

決算取締役会開催日
米国会計基準採用の有無

平成13年5月25日
無

特定取引勘定設置の有無

有

1.平成13年3月期の連結業績（平成12年4月1日～平成13年3月31日）

(注)原則として、12年3月期は旧中央信託銀行・旧三井信託銀行両行の計数を合算して表示しております。
また記載金額は百万円未満を切り捨てて表示しております。

(1)連結経営成績

	経常収益		経常利益		当期純利益	
	百万円	%	百万円	%	百万円	%
13 年 3 月 期	646,622	△35.8	54,163	△65.1	23,063	△51.8
12 年 3 月 期	1,007,896	0.3	155,347	-	47,815	-

	1株当たり 当期純利益	潜在株式調整後 1株当たり当期純利益	株主資本 当期純利益率	総 経 常 利 益 率	経 常 収 益 率
	円 銭	円 銭	%	%	%
13 年 3 月 期	21 95	12 85	5.3	0.4	8.4
12 年 3 月 期	中央信託 7 89	6 49	1.4	0.7	10.7
	三井信託 23 87	13 8	7.9	1.2	17.8

(注) 1. 持分法投資損益 平成13年3月期 - 百万円 平成12年3月期 △478 百万円
2. 期中平均株式数(連結) 13年3月期 810,213,897株 (普通株式)
3. 会計処理の方法の変更 無
4. 経常収益、経常利益、当期純利益におけるパーセント表示は、対前期増減率

(2)連結財政状態

	総 資 産	株 主 資 本	株主資本比率	1株当たり株主資本	連結自己資本比率 (国内基準)
	百万円	百万円	%	円 銭	%
13 年 3 月 期	13,887,995	778,529	5.6	427 19	[速報値] 10.76
12 年 3 月 期	15,297,537	1,139,991	7.5	中央信託 575 82 三井信託 314 84	_____

(注) 1. 期末発行済株式数(連結) 13年3月期 810,605,098株(普通株式)
2. 12年4月1日時点の自己資本比率は10.03%であります。

(3)連結キャッシュフローの状況

	営 業 活 動 に よ る キャッシュフロー	投 資 活 動 に よ る キャッシュフロー	財 務 活 動 に よ る キャッシュフロー	現金及び現金同等物 期 末 残 高
	百万円	百万円	百万円	百万円
13 年 3 月 期	△748,737	497,651	△19,215	173,369
12 年 3 月 期	282,087	△21,262	△44,373	441,517

(4)連結範囲及び持分法の適用に関する事項

連結子会社数 21 社 持分法適用非連結子会社数 - 社 持分法適用関連会社数 - 社

(5)連結範囲及び持分法の適用の異動状況

連結（新規） 14社 （除外） 2社 持分法（新規） - 社 （除外） 2社

2.平成14年3月期の連結業績予想（平成13年4月1日～平成14年3月31日）

	経常収益	経常利益	当期純利益
	百万円	百万円	百万円
中 間 期	300,000	20,000	7,000
通 期	590,000	50,000	20,000

(参考) 1株当たり予想当期純利益(通期) 18円 16銭

「13年3月期の連結業績」の指標算式

$$\text{○1株当たり当期純利益} \cdots \frac{\text{当期純利益} - \text{優先株配当金総額}}{\text{期中平均普通株式数} \times}$$

$$\text{○潜在株式調整後1株当たり当期純利益} \cdots \frac{\text{当期純利益} + \text{当期純利益調整額} - \text{優先株式配当金総額}}{\text{期中平均普通株式数} \times + \text{潜在株式数}}$$

$$\text{○株主資本当期純利益率} \cdots \frac{\text{当期純利益} - \text{優先株式配当金総額}}{\{(\text{期首株主資本} - \text{期首発行済優先株式数} \times \text{発行価額}) + (\text{期末株主資本} - \text{期末発行済優先株式数} \times \text{発行価額}) \} \div 2} \times 100$$

$$\text{○1株当たり株主資本} \cdots \frac{\text{期末株主資本} - \text{期末発行済優先株式数} \times \text{発行価額}}{\text{期末発行済普通株式数} \times}$$

「14年3月期の連結業績予想」指標算式

$$\text{○1株当たり予想当期純利益} \cdots \frac{\text{予想当期純利益} - \text{予想優先株式配当金総額}}{\text{期末(当期末)発行済普通株式数} \times}$$

※: 自己株式及び子会社の所有する親会社株式は除く

1. 企業集団の状況

(1) 企業集団の事業の内容

当社グループは、当社、子会社46社(うち連結子会社21社)および関連会社2社で構成され、

信託銀行業を中心に、証券業務、リース業務などの金融サービスを提供しています。

(2) 企業集団の事業系統図

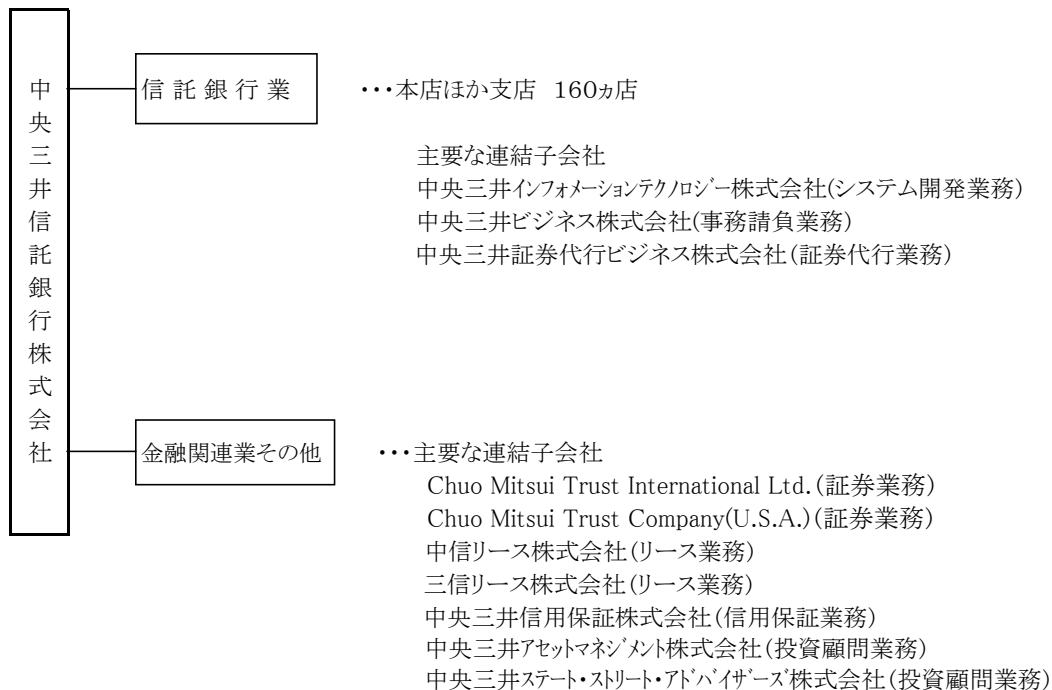
[信託銀行業]

(信託業務) 金銭信託、年金信託、貸付信託等の受託業務

(銀行業務) 預金業務、貸付業務、内国為替業務等

(併営業務) 証券代行業務、不動産業務等

[金融関連業その他]・・・リース業務、証券業務、信用保証業務、クレジットカード業務等



(注) 主要な連結子会社のうち、()内は主な事業の内容であります。

2 経営方針

(1) 基本方針

当社は、合併効果を早期かつ最大限に結実させ、いかなる環境変化にも対応し得る強固な経営基盤を築き上げるべく、以下を経営の基本方針としております。

第一に、強みとする業務に経営資源を効果的に配分し、効率的かつ競争力に優れた業務体制を構築いたします。

第二に、経営体質の一段の強化を図るため、「経営の健全化のための計画」に掲げたリストラ策をさらに大胆かつ前倒しで実施してまいります。

第三に、多様な顧客ニーズに対応するため、専門性を発揮し、特色ある高品質の商品・サービスを提供してまいります。

第四に、自らの責任において業務の健全性と適切性を確保するため、内部管理体制を一層充実させます。

第五に、透明性の高い経営を目指し、ディスクローズの拡充等に努めることにより社会からの評価の向上に努めます。

(2) 事業戦略

収益性の高い営業基盤を構築するために、事業戦略として以下の 4 つの重点分野に経営資源を効果的に配分し、強化しております。

第一に、ストックに着目した顧客ニーズに的確に応えるコンサルティング型の個人取引業務を推進しております。

第二に、受託資産運用・管理業務においては、マスタートラスト等将来の発展形を視野に入れ、信託本来の機能をフルに発揮するとともに、運用力の強化や管理業務の高度化を通じて競争力のある体制を構築いたします。

第三に、証券代行業務においては、コンサルティングの強化、並びにコスト競争力の高い体制を構築することで、業界トップの地位をさらに上伸させます。

第四に、事業会社貸出業務においては、拡大した営業基盤を活かし、大企業から中堅中小企業に亘る幅広いバランスのとれた業務を推進いたします。

また、信託銀行の専門性・ノウハウを活かし、不動産投資信託、資産流動化、ノンリコース・ローンやシンジケート・ローンのアレンジャー業務等新たな業務分野にも積極的に取り組んでおります。加えて、インターネット等の活用による新たなチャネルを駆使し、コンサルティングの拡充を図っております。

(3) 施策展開

以上の事業戦略に基づいて、当社は合併初年度より速やかに各施策を実施してまいりました。

まず、お客様の利便性の向上のため、投信販売専用拠点である「投信センター」を新宿西口に続き、昨年 7 月大阪・梅田と横浜駅西口にも開設し、資産運用に関する専門的な情報を提供し、投信のプロフェッショナルが常時ご相談を承るチャネルを拡充しました。また、中央三井アセットマネジメント株式

会社の商品開発力を積極的に活用すること等により、顧客ニーズに対応した商品のラインアップの拡充に努めております。加えて、よりお気軽に当社をご利用いただけるよう、商業施設、駅構内等利便性の高い場所に相談型のミニ店舗（名称：コンサルプラザ）を積極展開しておりますが、当期も新たに 3 店舗開設し、合計で 12 店舗となりました。

急拡大するインターネットにつきましては、重要なチャネルであるとの認識のもと、情報公開やサービス案内などホームページ（URL：http://www.chuomitsui.co.jp）の充実に注力する他、昨年 6 月には、「金融」に関するさまざまな情報、サービスをワンストップでご提供できる「金融ポータルサイト」（名称：マネーパーク、URL：http://www.money-pk.com）を他業態の 5 社と共同で開設いたしました。加えて、昨年 10 月にはインターネット上で投信取引の取扱い（名称：ソリューション・ダイレクト）を開始しました。

受託資産運用・管理業務に関しましては、高品質なパッシブ商品の提供及び運用に関する質の高いコンサルティングの実施等により、多くの年金基金からコア運用機関として位置付けられておりますが、さらに外貨資産における高品質な運用商品や付加価値の高い運用サービスの提供を目的とし、昨年 9 月に世界有数のパッシブ運用機関である米国ステート・ストリート・コーポレーションとの合併で、中央三井ステート・ストリート・アドバイザーズ株式会社を設立し、11 月より営業を開始しております。

受託資産管理業務につきましては、IT 投資とスケールメリットによりコストダウンを図ることによる「価格競争力による差別化」と、マスタートラストに代表される高付加価値情報の提供をはじめとした「品質による差別化」が必要であると考えております。このため、国内資産につきましては、住友信託銀行と大和銀行が設立した日本トラスティ・サービス信託銀行への対等出資による参加を協議中であり、また、外貨資産につきましては、世界有数のグローバル・カストディアンであるステート・ストリート銀行への委託によりコストダウンを図っていく方針です。

高付加価値情報の提供につきましては、全米最大のマスタートラストであるステート・ストリート銀行との提携を活用している他、昨年 10 月には、高付加価値情報の提供のためのインフラとして、インターネットを利用したオンライン情報提供システム（名称：マトリクス）を稼動の上、住友信託銀行・大和銀行と共同開発を進めてきたマスター・レコード・キープिंग・サービス（情報統合サービス）の提供を開始する等、サービス内容の充実化に取り組んでおります。

証券代行業務につきましては、東証マザーズやナスダックジャパンの公開市場の拡大に対応した積極的なコンサルティング活動を実施しております。また、事務運営体制の効率化の観点から、昨年 5 月に事務代行子会社 2 社を合併の上、証券代行事務の全面的なアウトソースを実施したのに加え、本年 1 月には、証券代行業務に係るシステムの完全統合をいたしました。加えて、更なる事務効率化・高度化の観点から、本年 8 月には、業界で初めての搬送システムである立体自動倉庫を導入することを決定しております。また、会社型不動産投信の上場化や、株主総会電子化等の新業務分野へも積極的に対応しております。

不動産流動化業務では、不動産業務・証券業務・証券代行業務・ファイナンス業務等幅広いサービスを提供できる信託銀行としての機能を十分に発揮し、積極的に取り組んでおります。

（４）経営管理施策

経営体制につきましては、合併時より取締役数を大幅に削減し、取締役会での議論の活性化と経営意思決定の迅速化を図ると同時に、業務執行体制を整備する観点から執行役員制度を導入し、経営意思決定機能と業務執行機能を明確化した新しい経営の枠組を取り入れております。

リスク管理につきましては、適切なリスク管理のもとで、必要なリスクテイクを行い、収益向上に結びつけていくことを基本方針としております。取締役会の統括のもと、内部管理経営会議、ALM経営会議を設置し、各種リスクや資産・負債の状況把握を行うとともに、資源配分や投資方針に関する審議を行う等、経営の健全性に資する体制を敷いており、今後も更なるリスク管理の高度化・充実に取り組んでまいります。

平成 13 年度より時価会計が本格適用されることとなりますが、政策投資株式につきましては、順次売却することにより今後も圧縮していくことで、株価変動リスクの縮減に努めてまいります。

受託資産管理業務においては、内部管理及び監査体制を強化する観点から、品質保証に関する国際規格である「ISO 9002」の認証を外国証券管理部門、投信代行部門で取得済みである他、合併前の両社で取得していた米国 SAS 70 型外部監査に準拠した監査証明を継続して取得いたしました。

加えて、わが国を代表する金融機関として、その社会的責任と公共的使命を果たすべく、コンプライアンス・プログラムを編成し実践することによりコンプライアンス重視の企業風土を醸成すると同時に、リスク管理態勢を常時点検しつつ適切なコントロールに努めてまいります。

（５）対処すべき課題

大手銀行の経営統合や異業種からの参入、あるいは、金融技術・情報技術の進展等経営環境が大きく変化している中、当社が対処すべき課題は、いかなる環境変化にも対応し得る収益性の高い営業基盤と健全な財務体質を併せ持つ強固な経営体を構築することにあります。

そのため前記 4 つの重点分野を強化すると同時に、「経営の健全化のための計画」に掲げたリストラ策をさらに大胆かつ前倒しで実施しております。

第一に、店舗網の再構築に関しまして、「経営の健全化のための計画」で平成 17 年 3 月末までに合併時点の 166 店舗から 35 店舗を統廃合し 131 店舗にするとしていたものを、本年 3 月末までに、同一ビル内に同居することによる実質的な統合効果を含めると既に 17 店舗の削減を実施いたしました。平成 13 年度におきましても上期中を目処に 24 店舗の実質的な削減を予定しており、最終的には平成 15 年 3 月末を目途に通常店舗を 91 店舗とする計画です。

一方で、通常店舗を補完するために、サテライト型小型店舗やコンサルプラザを合計で 50 店舗程度設置いたします。これらにより、さらに効率的な店舗運営を実施していく計画です。

第二に、人員に関しまして、「経営の健全化のための計画」では、嘱託等を除き、本年 3 月末で 8,000 名、平成 17 年 3 月末で 6,800 名体制を計画していたものを、本年 3 月末で 7,362 名と前倒しで計画を達成しております。今後も店舗運営並びに本部機能の一層の効率化を図るとともにアウトソーシングを実施することで、平成 17 年 3 月末までに 5,500 名体制を目指してまいります。

本部組織につきましては、合併当初から大幅にスリム化してスタートし、その後も業務が重複する部

を中心に統合しておりますが、今後も更なるスリム化を実施していく予定であります。加えて、業務が重複している子会社につきましては、昨年 5 月に 3 業態におきまして合併を行っておりますが、更なる効率化を進めてまいります。

一方、勘定系システムの統合につきましては、従来の延長線上での単純なシステム統合ではなく、最新機能を備えた新たなシステム基盤を、平成 14 年上期を目途に構築いたします。

また、人事制度につきましては、本年 1 月から新制度を開始いたしました。新人事制度は個人の「能力」・「役割」・「成果」及び「専門性」をより重視したものであり、その上で能力・経験に応じた適材適所の人事配置を実施しております。

以上を通じまして、当社は合併により実現したスケールアップとレベルアップをさらに高めることで、確固たる収益基盤・財務基盤を築いてまいります。株主の皆様におかれましては、今後とも格別のご理解とご協力を賜りますようお願い申し上げます。

（６）会社の利益配分に関する基本方針等

当社は、金融機関としての公共性に鑑み、資産の健全性の確保、適正な内部留保の充実に努めるとともに安定した配当を実施することを基本方針としております。この方針のもと、期末配当金につきましては、普通株式は 1 株当たり 2 円 50 銭（年間配当金 5 円）、第一回甲種優先株式は 1 株当たり 20 円（年間配当金 40 円）、第二回甲種優先株式は 1 株当たり 7 円 20 銭（年間配当金 14 円 40 銭）、第三回甲種優先株式は 1 株あたり 10 円（年間配当金 20 円）として株主総会に付議することとしております。

平成 14 年 3 月期の年間配当金の見通しにつきましては、普通株式は 1 株当たり 5 円、第一回甲種優先株式は 1 株当たり 40 円、第二回甲種優先株式は 1 株当たり 14 円 40 銭、第三回甲種優先株式は 1 株あたり 20 円の予定であります。

3. 経営成績

(1) 当期の概況

当期の連結ベースの経営成績は経常収益が6,466億円、経常利益が541億円、当期純利益が230億円となりました。事業の種類別セグメントの業績は、信託銀行業については、経常収益5,975億円、経常利益528億円、リース業務、証券業務等の金融関連業その他については、経常収益571億円、経常利益14億円となりました。

資産負債の状況につきましては、預金は前年度比1,541億円増加して7兆5,269億円となりました。一方、貸出金は、329億円減少して7兆7,074億円となり、総資産は1兆4,095億円減少して13兆8,879億円となりました。信託勘定（当社単体）につきましては、信託財産総額は9,534億円減少して43兆4,514億円となりました。貸出金は7,288億円減少して3兆2,445億円となり、有価証券は3,748億円増加して22兆3,752億円となりました。

キャッシュフローの状況につきましては、資金の運用・調達や貸出金・預金の増減等の営業活動によるものが7,487億円の支出、有価証券の取得・売却や動産不動産の取得・売却等の投資活動によるものが4,976億円の収入、劣後調達等の財務活動によるものが192億円の支出となった結果、現金及び現金同等物の期末残高は1,733億円となりました。

自己資本比率（国内基準）は、連結自己資本比率が10.76%、単体自己資本比率が10.79%となりました。

(2) 平成14年3月期の見通し

平成14年3月期の連結決算の見通しにつきましては、経常収益は5,900億円、経常利益は500億円、当期純利益は200億円を予想しております。

同じく当社単体決算の見通しにつきましては、経常収益は5,400億円、経常利益は500億円、当期純利益は260億円を予想しております。

連結貸借対照表

中央三井信託銀行株式会社

(単位:百万円)

科 目	当連結会計年度末 (A) (平成13年3月31日現在)	前連結会計年度末 (B) (平成12年3月31日現在)	比 較 (A-B)
(資 産 の 部)			
現 金 預 け 金	500,364	1,009,217	△ 508,853
コールローン及び買入手形	181,639	247,500	△ 65,860
買 入 金 銭 債 権	—	14,232	△ 14,232
特 定 取 引 資 産	7,766	14,390	△ 6,623
金 銭 の 信 託	94,736	160,492	△ 65,755
有 価 証 券	4,261,599	4,976,641	△ 715,042
貸 出 金	7,707,472	7,740,466	△ 32,994
外 国 為 替	13,383	13,032	351
そ の 他 資 産	318,516	326,424	△ 7,908
動 産 不 動 産	294,518	306,656	△ 12,137
繰 延 税 金 資 産	239,899	258,702	△ 18,803
支 払 承 諾 見 返	406,580	463,394	△ 56,813
貸 倒 引 当 金	△ 138,290	△ 230,693	92,402
投 資 損 失 引 当 金	△ 190	△ 2,919	2,729
資 産 の 部 合 計	13,887,995	15,297,537	△ 1,409,541
(負 債 の 部)			
預 金	7,526,913	7,372,768	154,144
譲 渡 性 預 金	333,552	537,464	△ 203,912
コールマネー及び売渡手形	37,412	135,046	△ 97,634
特 定 取 引 負 債	5,206	12,253	△ 7,047
借 用 金	463,343	510,252	△ 46,909
外 国 為 替	54	64	△ 9
社 債	124,840	124,290	550
転 換 社 債	35,023	37,745	△ 2,722
信 託 勘 定 借 債	3,913,444	4,592,756	△ 679,311
そ の 他 負 債	208,275	275,152	△ 66,877
退 職 給 与 引 当 金	—	21,784	△ 21,784
退 職 給 付 引 当 金	10,945	—	10,945
債 権 売 却 損 失 引 当 金	8,745	15,863	△ 7,118
信 託 契 約 為 替 評 価 引 当 金	26,760	47,627	△ 20,866
特 別 法 上 の 引 当 金	0	0	—
再 評 価 に 係 る 繰 延 税 金 負 債	3,360	3,430	△ 69
支 払 承 諾	406,580	463,394	△ 56,813
負 債 の 部 合 計	13,104,457	14,149,895	△ 1,045,437
(少 数 株 主 持 分)			
少 数 株 主 持 分	5,009	7,650	△ 2,641
(資 本 の 部)			
資 本 金	322,875	559,756	△ 236,880
資 本 準 備 金	295,278	438,705	△ 143,427
再 評 価 差 額 金	5,225	5,168	56
連 結 剰 余 金	157,939	138,939	19,000
為 替 換 算 調 整 勘 定	228	—	228
計	781,547	1,142,570	△ 361,023
自 己 株 式	△ 5	△ 6	1
子 会 社 の 所 有 する 親 会 社 株 式	△ 3,012	△ 2,572	△ 440
資 本 の 部 合 計	778,529	1,139,991	△ 361,462
負債、少数株主持分及び資本の部合計	13,887,995	15,297,537	△ 1,409,541

〔平成12年度連結貸借対照表注記〕

- 記載金額は百万円未満を切り捨てて表示しております。
- 金利、通貨の価格、有価証券市場における相場その他の指標に係る短期的な変動、市場間の格差等を利用して利益を得る等の目的（以下「特定取引目的」）の取引については、取引の約定時点を基準とし、連結貸借対照表上「特定取引資産」及び「特定取引負債」に計上しております。

特定取引資産及び特定取引負債の評価は、有価証券及び金銭債権等については連結決算日の時価により、スワップ・先物・オプション取引等の派生商品については連結決算日において決済したものとみなした額により行っております。

- 有価証券の評価は、満期保有目的の債券については移動平均法による償却原価法、その他有価証券については、移動平均法による原価法又は償却原価法により行っております。
- 有価証券運用を主目的とする単独運用の金銭の信託において信託財産として運用されている有価証券の評価は、時価法により行っております。
- デリバティブ取引（特定取引目的の取引を除く。）の評価は、時価法により行っております。
- 当社の動産不動産の減価償却は、定率法（ただし、平成10年4月1日以後に取得した建物（建物附属設備を除く。）については、定額法）を採用しております。なお、主な耐用年数は次のとおりであります。

建 物 10年～50年

動 産 3年～ 8年

また、取得価額が10万円以上20万円未満の資産については、3年間で均等償却する方法を採用しております。

連結される子会社及び子法人等の動産不動産については、資産の見積耐用年数に基づき、主として定額法により償却しております。

- 自社利用のソフトウェアについては、当社及び連結される子会社及び子法人等で定める利用可能期間（主として5年）に基づく定額法により償却しております。

- 当社の外貨建資産・負債については、主として連結決算日の為替相場による円換算額を付しております。

連結される子会社及び子法人等の外貨建資産・負債については、それぞれの決算日等の為替相場により換算しております。

なお、国内の連結される子会社及び子法人等は、当連結会計年度から改訂後の外貨建取引等会計処理基準（「外貨建取引等会計処理基準の改訂に関する意見書」（企業会計審議会平成11年10月22日））を適用しております。この結果、従来の方法によった場合と比較して、経常利益は104百万円、税金等調整前当期純利益は104百万円減少しております。

また、前連結会計年度において「資産の部」に計上していた為替換算調整勘定は、連結財務諸表規則の改正により、「資本の部」並びに「少数株主持分」に含めて計上しております。

- 当社の貸倒引当金は、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。

破産、特別清算等、法的に経営破綻の事実が発生している債務者（以下、「破綻先」という）に係る債権及びそれと同等の状況にある債務者（以下、「実質破綻先」という）の債権については、下記直接減額後の帳簿価額から、担保の処分可能見込額及び保証による回収可能見込額を控除し、その残額を計上しております。また、現在は経営破綻の状況にないが、今後経営破綻に陥る可能性が大きいと認められる債務者に係る債権については、債権額から、担保の処分可能見込額及び保証による回収可能見込額を控除し、その残額のうち、債務者の支払能力を総合的に判断し必要と認める額を計上しております。上記以外の債権については、過去の一定期間における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。なお、特定海外債権については、対象国の政治経済情勢等に起因して生ずる損失見込額を特定海外債権引当勘定（租税特別措置法第55条の2の海外投資等損失準備金を含む）として計上しております。

すべての債権は、資産の自己査定基準に基づき、各営業店及び審査各部が資産査定を実施し、当該部署から独立した資産監査部が査定方法等の適正性を監査し、その査定結果に基づいて上記の引当を行っております。

なお、破綻先及び実質破綻先に対する担保・保証付債権等については、債権額から担保の評価額及び保証による回収が可能と認められる額を控除した残額を取立不能見込額として債権額から直接減額しており、その金額は673,321百万円であります。

連結される子会社及び子法人等の貸倒引当金は、一般債権については過去の貸倒実績率等を勘案して必要と認めた額を、貸倒懸念債権等特定の債権については、個別に回収可能性を勘案し、回収不能見込額をそれぞれ引き当てております。

- 投資損失引当金は、破綻懸念先の発行する有価証券について、帳簿価額から担保の処分可能見込額及び保証による回収可能見込額を控除し、その残額のうち、債務者の支払能力を総合的に判断し将来発生する可能性のある損失を見積り、必要と認められる額を計上しております。

- 退職給付引当金は、従業員の退職給付に備えるため、当連結会計年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき、必要額を計上しております。また、過去勤務債務及び数理計算上の差異の費用処理方法は以下のとおりであります。

過去勤務債務 発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（5年）による定額法により損益処理

数理計算上の差異 発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（１０年）による定額法により、翌連結会計年度から費用処理

なお、会計基準変更時差異（５７,０９９百万円）については、５年による按分額を費用処理しております。

12. 債権売却損失引当金は、(株)共同債権買取機構に売却した不動産担保付債権の担保価値を勘案し、将来発生する可能性のある損失を見積り、必要と認められる額を計上しております。なお、この引当金は商法第２８７条ノ２に規定する引当金であります。
13. 信託契約為替評価引当金は、合同運用金銭信託（有価証券運用口）で保有する有価証券の為替含み損相当額を引き当てております。なお、この引当金は商法第２８７条ノ２に規定する引当金であります。
14. 当社及び国内の連結される子会社及び子法人等のリース物件の所有権が借主に移転すると認められるもの以外のファイナンス・リース取引については、通常の賃貸借取引に準じた会計処理によっております。
15. 当社のヘッジ会計の方法は、一部の資産・負債について、繰延ヘッジあるいは金利スワップの特例処理を行っております。
16. 当社及び国内の連結される子会社及び子法人等の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。ただし、動産不動産に係る控除対象外消費税等は当連結会計年度の費用に計上しております。
17. 特別法上の引当金は、次のとおり計上しております。

証券取引責任準備金	０百万円	証券取引法第６５条の２第７項において準用する証券取引法第５１条の規定に基づく準備金であります。
-----------	------	---

18. 動産不動産の減価償却累計額 ２１７,３９７百万円
19. 動産不動産の圧縮記帳額 ７,６２４百万円
20. 連結貸借対照表に計上した動産不動産のほか、電子計算機等の一部についてはリース契約により使用しております。
21. 貸出金のうち、破綻先債権額は５９,０３３百万円、延滞債権額は２１１,４０１百万円であります。

なお、破綻先債権とは、元本又は利息の支払の遅延が相当期間継続していることその他の事由により元本又は利息の取立て又は弁済の見込みがないものとして未収利息を計上しなかった貸出金（貸倒償却を行った部分を除く。以下「未収利息不計上貸出金」という。）のうち、法人税法施行令（昭和４０年政令第９７号）第９６条第１項第３号のイからホまでに掲げる事由又は同項第４号に規定する事由が生じている貸出金であります。

また、延滞債権とは、未収利息不計上貸出金であって、破綻先債権及び債務者の経営再建又は支援を図ることを目的として利息の支払を猶予した貸出金以外の貸出金であります。

22. 貸出金のうち、３ヵ月以上延滞債権額は ２,１４５百万円であります。

なお、３ヵ月以上延滞債権とは、元本又は利息の支払が約定支払日の翌日から３月以上遅延している貸出金で破綻先債権及び延滞債権に該当しないものであります。

23. 貸出金のうち、貸出条件緩和債権額は４０６,１９９百万円であります。

なお、貸出条件緩和債権とは、債務者の経営再建又は支援を図ることを目的として、金利の減免、利息の支払猶予、元本の返済猶予、債権放棄その他の債務者に有利となる取決めを行った貸出金で破綻先債権、延滞債権及び３ヵ月以上延滞債権に該当しないものであります。

24. 破綻先債権額、延滞債権額、３ヵ月以上延滞債権額及び貸出条件緩和債権額の合計額は６７８,７７９百万円であります。

なお、21.から24.に掲げた債権額は、貸倒引当金控除前の金額であります。

25. 手形割引により取得した商業手形の額面金額は、６７,８７０百万円であります。

26. 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	７１７,８６７百万円
貸出金	３０８,８１６百万円
その他資産	１,１９３百万円

担保資産に対応する債務

預金	９０９百万円
売渡手形	２７,５００百万円
借入金	１５,８１５百万円

上記のほか、為替決済、デリバティブ等の取引の担保あるいは先物取引証拠金等の代用として有価証券 ４６５,０２７百万円、預け金３５３百万円を差し入れております。

なお、動産不動産のうち保証金権利金は３２,１５３百万円であります。

27. ヘッジ手段に係る損益または評価差額は、純額で繰延ヘッジ損失としてその他資産に含めて計上しております。なお、上記相殺前の繰延ヘッジ損失の総額は１,３２９百万円、繰延ヘッジ利益の総額は２４０百万円であります。

28. 「大阪府における銀行業等に対する事業税の課税標準等の特例に関する条例」（平成１２年大阪府条例第１３１号）が平成１２年６月９日に公布されたことから、当社の繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用する法定実効税率を、当連結会

計年度より前連結会計年度の 39.56% から39.14% に変更しております。この変更により、繰延税金資産の金額は 2,222百万円減少し、当連結会計年度に計上された法人税等調整額の金額は同額増額しております。また、再評価に係る繰延税金負債の金額は31百万円減少し、再評価差額金の金額は同額増加しております。

29. 三井信託銀行株式会社から継承した土地については、土地の再評価に関する法律（平成10年3月31日公布 法律第34号）に基づき、事業用の土地の再評価を行い、評価差額については、当該評価差額に係る税金相当額を「再評価に係る繰延税金負債」として負債の部に計上し、これを控除した金額を「再評価差額金」として資本の部に計上しております。

再評価を行った年月日 平成10年3月31日

同法律第3条第3項に定める再評価の方法

土地の再評価に関する法律施行令（平成10年3月31日公布政令第119号）第2条第1号に定める標準地の公示価格、同条第2号に定める基準地の標準価格及び同条第3号に定める当該事業用土地の課税台帳に登録されている価格に基づいて、合理的な調整（時点修正、地域格差及び個別格差の補正）を行って算出しております。

同法律第10条に定める再評価を行った事業用土地の当連結会計年度末における時価の合計額と当該事業用土地の再評価後の帳簿価額の合計額との差額 3,452百万円

30. 借入金には、他の債務よりも債務の履行が後順位である旨の特約が付された劣後特約付借入金368,000百万円が含まれております。

31. 社債は、永久劣後特約付社債100,000百万円及び劣後特約付社債24,840百万円であります。

32. 転換社債は、永久劣後特約付転換社債33,510百万円及び劣後特約付転換社債1,513百万円であります。

33. 1株当たりの純資産額 427円18銭

34. 有価証券の時価、評価差額等に関する事項は次のとおりであります。これらには、「有価証券」のほか、「特定取引資産」中の商品有価証券及びコマーシャル・ペーパーが含まれております。以下38. まで同様であります。

売買目的有価証券（「特定取引資産」に計上されたもの）

連結貸借対照表計上額		1,389百万円			
当連結会計年度の損益に含まれた評価差額		0百万円			
満期保有目的の債券で時価のあるもの					
	連 結 貸 借	時 価	差 額		
	対照表計上額			うち益	うち損
国債	77,396百万円	76,938百万円	△457百万円	264百万円	722百万円
地方債	56,722	61,755	5,032	5,033	1
社債	14,662	15,575	913	916	3
その他	—	—	—	—	—
合計	148,782	154,269	5,487	6,214	726

その他有価証券で時価のあるもの

当連結会計年度においては、その他有価証券のうち時価のあるものについて時価評価を行っておりません。なお、平成12年大蔵省令第9号附則第3項によるその他有価証券に係る連結貸借対照表計上額等は次のとおりであります。

	連結貸借 対照表計上額	時 価	差 額	うち益	うち損
株式	1,864,285百万円	1,758,452百万円	△105,832百万円	130,713百万円	236,546百万円
債券	1,498,852	1,513,197	14,344	15,568	1,223
国債	1,168,369	1,173,092	4,723	5,929	1,205
地方債	44,277	45,935	1,657	1,658	0
社債	286,205	294,169	7,963	7,981	17
その他	635,896	578,179	△57,716	3,885	61,602
合計	3,999,035	3,849,830	△149,205	150,167	299,373

評価差額金相当額 △90,816百万円

繰延税金資産相当額 58,388

なお、その他有価証券を時価評価した場合、上記の評価差額金相当額のうち少数株主持分相当額504百万円を控除した△91,320百万円が、「評価差額金」に計上されます。

35. 当連結会計年度中に売却した満期保有目的の債券はありません。

36. 当連結会計年度中に売却したその他有価証券は次のとおりであります。

売却額	売却益	売却損
8,254,565百万円	109,965百万円	12,229百万円

37. 時価のない有価証券のうち、主なものの内容と連結貸借対照表計上額は、次のとおりであります。

内 容	連結貸借対照表計上額
その他有価証券	
非上場株式（店頭売買株式を除く）	55,326百万円
非上場外国証券	21,705
出資証券	6,209

38. その他有価証券のうち満期があるもの及び満期保有目的の債券の期間ごとの償還予定額は次のとおりであります。

	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
債券	556,247百万円	522,065百万円	317,021百万円	252,300百万円
国債	493,527	233,334	266,604	252,300
地方債	25,660	40,278	35,062	—
社債	37,059	248,453	15,354	—
その他	23,923	253,621	68,648	138,227
合計	580,170	775,686	385,669	390,527

39. 金銭の信託の保有目的別の内訳は次のとおりであります。

運用目的の金銭の信託	
連結貸借対照表計上額	86,230百万円
当連結会計年度の損益に含まれた評価差額	△ 825

その他の金銭の信託

当連結会計年度においては、その他の金銭の信託について時価評価を行っておりません。なお、その他の金銭の信託に係る連結貸借対照表計上額等は次のとおりであります。

連結貸借対照表計上額	8,505百万円
時価	12,249
差額	3,743
うち益	3,743
うち損	—
評価差額金相当額	2,169
繰延税金負債相当額	1,574

40. 使用貸借または賃貸借契約により貸し付けている有価証券は、従来「有価証券」中の貸付有価証券に計上しておりましたが、金融商品に係る会計基準（「金融商品に係る会計基準の設定に関する意見書」（企業会計審議会平成11年1月22日））の適用に伴い、当連結会計年度よりその種類毎に「有価証券」中の国債、地方債等に計上しております。当連結会計年度末における使用貸借または賃貸借契約により貸し付けている有価証券は659百万円であります。

41. 当座貸越契約及び貸付金に係るコミットメントライン契約は、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1,199,119百万円であり、このうち契約残存期間が1年以内のものが1,158,042百万円あります。

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及び連結される子会社及び子法人等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、その他相当の事由があるときは、当社及び連結される子会社及び子法人等が実行申し込みを受けた融資の拒絶また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。

42. 当連結会計年度末の退職給付債務等は以下のとおりであります。

退職給付債務	△ 212,201百万円
年金資産（時価）	200,684
未積立退職給付債務	△ 11,517
会計基準変更時差異の未処理額	45,679
未認識数理計算上の差異	18,438
未認識過去勤務債務（債務の減額）	△ 3,978
連結貸借対照表計上額の純額	48,622
前払年金費用	59,567
退職給付引当金	△ 10,945

なお、一部の連結される子会社及び子法人等は総合設立型厚生年金基金制度に加入しており、その年金資産は1,158百

万円であります。

43. 当社の受託する元本補てん契約のある信託の元本金額は、合同運用指定金銭信託1,298,795百万円、貸付信託5,740,574百万円であります。

連 結 損 益 計 算 書

中央三井信託銀行株式会社

(単位:百万円)

科 目	当連結会計年度(A) 平成12年4月 1日から 平成13年3月31日まで	前連結会計年度(B) 平成11年4月 1日から 平成12年3月31日まで	比 較 (A - B)
経 常 収 益	646,622	1,007,896	△ 361,273
信 託 報 酬	124,366	126,846	△ 2,480
資 金 運 用 収 益	232,541	378,532	△ 145,990
貸 出 金 利 息	152,294	146,257	6,036
有 価 証 券 利 息 配 当 金	70,275	124,658	△ 54,383
コールローン及び買入手形利息	807	999	△ 192
預 け 金 利 息	6,108	10,508	△ 4,399
そ の 他 の 受 入 利 息	3,055	96,107	△ 93,052
役 務 取 引 等 収 益	56,940	57,257	△ 316
特 定 取 引 収 益	946	32	914
そ の 他 業 務 収 益	54,058	46,788	7,269
そ の 他 経 常 収 益	177,769	398,439	△ 220,669
経 常 費 用	592,459	852,549	△ 260,089
資 金 調 達 費 用	143,251	282,558	△ 139,307
預 金 利 息	56,678	63,277	△ 6,599
譲 渡 性 預 金 利 息	231	557	△ 325
コールマネー及び売渡手形利息	325	594	△ 269
借 用 金 利 息	14,370	16,552	△ 2,181
社 債 利 息	2,560	2,465	94
転 換 社 債 利 息	457	488	△ 30
そ の 他 の 支 払 利 息	68,627	198,622	△ 129,995
役 務 取 引 等 費 用	6,609	7,871	△ 1,261
特 定 取 引 費 用	137	1,710	△ 1,573
そ の 他 業 務 費 用	3,783	25,077	△ 21,294
営 業 経 費	186,312	201,155	△ 14,842
そ の 他 経 常 費 用	252,365	334,176	△ 81,810
貸 倒 引 当 金 繰 入 額	15,248	63,295	△ 48,046
そ の 他 の 経 常 費 用	237,117	270,880	△ 33,763
経 常 利 益	54,163	155,347	△ 101,184
特 別 利 益	10,928	3,314	7,613
動 産 不 動 産 処 分 益	0	260	△ 259
償 却 債 権 取 立 益	6,113	2,873	3,239
証 券 取 引 責 任 準 備 金 取 崩 額	—	0	△ 0
そ の 他 の 特 別 利 益	4,814	180	4,634
特 別 損 失	18,585	38,808	△ 20,223
動 産 不 動 産 処 分 損	4,686	2,067	2,618
そ の 他 の 特 別 損 失	13,898	36,740	△ 22,842
税 金 等 調 整 前 当 期 純 利 益	46,506	119,853	△ 73,347
法 人 税、住 民 税 及 び 事 業 税	4,792	18,307	△ 13,515
法 人 税 等 調 整 額	18,769	52,455	△ 33,686
少 数 株 主 利 益	△ 118	1,274	△ 1,393
当 期 純 利 益	23,063	47,815	△ 24,752

[平成12年度連結損益計算書注記]

1. 記載金額は百万円未満を切り捨てて表示しております。
2. 1株当たり当期純利益金額 21円95銭
3. 潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額 12円84銭
4. 特定取引目的の取引については、取引の約定時点を基準とし、当該取引からの損益を連結損益計算書上「特定取引収益」及び「特定取引費用」に計上しております。

特定取引収益及び特定取引費用の損益計上は、当連結会計年度中の受払利息等に、有価証券、金銭債権等については前連結会計年度末と当連結会計年度末における評価損益の増減額を、派生商品については前連結会計年度末と当連結会計年度末におけるみなし決済からの損益相当額の増減額を加えております。

5. その他の経常費用には、(株)共同債権買取機構へ不動産担保付債権を売却したことによる損失975百万円、債権売却損失引当金繰入額1,459百万円及びその他の債権の処理損失36,744百万円を含んでおります。
6. その他の特別利益には、株式等売却益4,814百万円を含んでおります。
7. その他の特別損失には、退職給付会計導入に伴う会計基準変更時差異の費用処理額11,419百万円を含んでおります。
8. 当連結会計年度から退職給付に係る会計基準（「退職給付に係る会計基準の設定に関する意見書」（企業会計審議会平成10年6月16日））を適用しております。この結果、従来の方法によった場合と比較して、経常利益は1,409百万円、税金等調整前当期純利益は12,829百万円減少しております。

なお、退職給与引当金及び企業年金制度の過去勤務債務等に係る未払金は、退職給付引当金に含めて表示しております。

9. 当連結会計年度から金融商品に係る会計基準を適用し、有価証券の評価の方法、デリバティブの評価の方法、ヘッジ会計の方法等について変更しております。この結果、従来の方法によった場合と比較して、経常利益は26,061百万円、税金等調整前当期純利益は26,061百万円増加しております。また、ヘッジ会計を適用するデリバティブ取引の損益については、従来と同じ損益科目で表示しておりますが、収益及び費用の表示は、金融商品に係る会計基準の適用に伴い、当連結会計年度より従来の総額表示から純額表示に変更しております。この変更による経常利益及び税金等調整前当期純利益の影響はありませんが、従来の方法によった場合に比べ、経常収益及び経常費用はそれぞれ1,031百万円減少しております。

なお、銀行業におけるヘッジ会計に係るデリバティブ取引の収益及び費用の表示に関し、日本公認会計士協会とも協議の結果、下期において、総額表示に比べて純額表示がより適正な表示であるとの結論に達したために、中間連結会計期間においては、従来の総額表示によっております。中間連結会計期間において、ヘッジ会計を適用するデリバティブ取引について収益及び費用を純額で表示した場合には、中間連結会計期間の経常利益及び税金等調整前中間純利益の影響はありませんが、経常収益及び経常費用はそれぞれ539百万円減少いたします。

10. 利益に関連する金額を課税標準とする事業税以外の事業税は、その他の経常費用に計上しております。なお、当社の東京都に係る事業税については、従来、「法人税、住民税及び事業税」に計上しておりましたが、「東京都における銀行業等に対する事業税の課税標準等の特例に関する条例」（平成12年東京都条例第145号）が平成12年4月1日に施行されたことに伴い、当連結会計年度より、その他の経常費用に4,199百万円計上しております。

連結剰余金計算書

中央三井信託銀行株式会社
(単位:百万円)

科 目	当連結会計年度(A) 平成12年4月 1日から 平成13年3月31日まで	前連結会計年度(B) 平成11年4月 1日から 平成12年3月31日まで	比 較 (A - B)
連 結 剰 余 金 期 首 残 高	23,072	98,078	△ 75,005
連 結 剰 余 金 増 加 高	118,294	12,136	106,157
合 併 に 伴 う 期 首 剰 余 金 増 加 高	115,866	—	115,866
連 結 子 会 社 の 持 分 比 率 変 動 に よ る 剰 余 金 増 加 高	1,779	—	1,779
連 結 子 会 社 の 合 併 に 伴 う 剰 余 金 増 加 高	—	53	△ 53
連 結 子 会 社 の 減 少 に 伴 う 剰 余 金 増 加 高	642	7,481	△ 6,839
持 分 法 適 用 会 社 の 減 少 に 伴 う 剰 余 金 増 加 高	—	813	△ 813
再 評 価 差 額 金 取 崩 額	5	3,787	△ 3,781
連 結 剰 余 金 減 少 高	6,490	19,091	△ 12,600
連 結 子 会 社 の 減 少 に 伴 う 剰 余 金 減 少 高	—	2,003	△ 2,003
配 当 金	6,490	12,082	△ 5,592
合 併 交 付 金	—	5,005	△ 5,005
当 期 純 利 益	23,063	47,815	△ 24,752
連 結 剰 余 金 期 末 残 高	157,939	138,939	19,000

連結キャッシュ・フロー計算書

中央三井信託銀行株式会社

(単位:百万円)

	当連結会計年度(A) 平成12年4月 1日から 平成13年3月31日まで	前連結会計年度(B) 平成11年4月 1日から 平成12年3月31日まで	比 較 (A - B)
I 営業活動によるキャッシュ・フロー			
税金等調整前当期純利益	46,506	119,853	△ 73,347
減価償却費	39,064	34,591	4,472
持分法による投資損益(△)	—	478	△ 478
貸倒引当金の増加額	△ 92,367	△ 48,282	△ 44,084
投資損失引当金の増加額	△ 2,606	870	△ 3,477
債権売却損失引当金の増加額	△ 7,118	498	△ 7,616
退職給与引当金の増加額	△ 21,784	△ 2,042	△ 19,741
退職給付引当金の増加額	10,945	—	10,945
信託契約為替評価引当金の増加額	△ 20,866	47,627	△ 68,494
資金運用収益	△ 232,541	△ 378,532	145,990
資金調達費用	143,251	282,558	△ 139,307
有価証券関係損益(△)	△ 74,080	△ 290,190	216,110
金銭の信託の運用損益(△)	△ 3,725	△ 6,622	2,897
為替差損益(△)	△ 66,078	61,114	△ 127,193
動産不動産処分損益(△)	4,689	1,807	2,882
特定取引資産の純増(△)減	6,623	32,712	△ 26,088
特定取引負債の純増減(△)	△ 7,047	△ 10,641	3,594
貸出金の純増(△)減	38,093	△ 758,135	796,228
預金の純増減(△)	154,125	1,182,872	△ 1,028,746
譲渡性預金の純増減(△)	△ 203,912	△ 120,923	△ 82,988
借入金(劣後特約付借入金を除く)の純増減(△)	△ 24,065	△ 57,683	33,618
預け金(日銀預け金を除く)の純増(△)減	240,704	△ 7,740	248,444
コールローン等の純増(△)減	80,092	22,177	57,914
債券借入取引担保金の純増(△)減	—	56,255	△ 56,255
コールマネー等の純増減(△)	△ 97,634	7,101	△ 104,736
債券貸付取引担保金の純増減(△)	△ 68,544	△ 45,342	△ 23,202
外国為替(資産)の純増(△)減	△ 351	6,800	△ 7,152
外国為替(負債)の純増減(△)	△ 9	△ 6,796	6,786
信託勘定借の純増減(△)	△ 679,311	101,567	△ 780,879
資金運用による収入	274,112	418,336	△ 144,223
資金調達による支出	△ 181,410	△ 303,852	122,441
その他	12,743	△ 52,066	64,809
小計	△ 732,505	288,372	△ 1,020,877
法人税等の支払額	△ 16,232	△ 6,284	△ 9,947
営業活動によるキャッシュ・フロー	△ 748,737	282,087	△ 1,030,825

	当連結会計年度(A) 平成12年4月 1日から 平成13年3月31日まで	前連結会計年度(B) 平成11年4月 1日から 平成12年3月31日まで	比 較 (A - B)
II 投資活動によるキャッシュ・フロー			
有価証券の取得による支出	△ 11,397,093	△ 9,549,082	△ 1,848,011
有価証券の売却による収入	8,042,181	8,652,134	△ 609,953
有価証券の償還による収入	3,826,236	896,404	2,929,832
金銭の信託の増加による支出	△ 11,701	△ 95,135	83,434
金銭の信託の減少による収入	77,872	111,670	△ 33,798
動産不動産の取得による支出	△ 77,798	△ 53,588	△ 24,210
動産不動産の処分による支出	△ 1,105	—	△ 1,105
動産不動産の売却による収入	39,059	16,325	22,734
連結範囲の変動を伴う子会社株式の売却による収入	—	8	△ 8
投資活動によるキャッシュ・フロー	497,651	△ 21,262	518,913
III 財務活動によるキャッシュ・フロー			
劣後特約付借入による収入	30,000	5,000	25,000
劣後特約付借入金返済による支出	△ 36,975	△ 27,500	△ 9,475
劣後特約付社債・転換社債の償還による支出	△ 375	△ 10,419	10,044
少数株主からの払込みによる収入	90	—	90
配当金支払額	△ 6,490	△ 12,082	5,592
少数株主への配当金支払額	△ 20	△ 8	△ 11
自己株式の取得による支出	△ 439	—	△ 439
自己株式の売却による収入	—	637	△ 637
合併交付金の支払額	△ 5,005	—	△ 5,005
財務活動によるキャッシュ・フロー	△ 19,215	△ 44,373	25,157
IV 現金及び現金同等物に係る換算差額	2,163	△ 310	2,474
V 現金及び現金同等物の増加額	△ 268,138	216,140	△ 484,278
VI 現金及び現金同等物の期首残高	281,218	226,195	55,022
VII 合併に伴う現金及び現金同等物の増加額	160,299	765	159,534
VIII 連結除外に伴う現金及び現金同等物の減少額	△ 10	△ 1,583	1,573
IX 現金及び現金同等物の期末残高	173,369	441,517	△ 268,148

[平成12年度連結キャッシュ・フロー計算書注記]

- 注 1. 記載金額は百万円未満を切り捨てて表示しております。
2. 連結キャッシュ・フロー計算書における資金の範囲は、連結貸借対照表上の「現金預け金」（当社は現金及び日本銀行への預け金）であります。
3. 現金及び現金同等物の期末残高と連結貸借対照表に掲記されている科目の金額との関係は次のとおりであります。
- | | |
|-----------|--------------|
| 現金預け金勘定 | 500,364百万円 |
| 普通預け金 | △ 236,269百万円 |
| 外貨預け金 | △ 86,549百万円 |
| その他 | △ 4,176百万円 |
| 現金及び現金同等物 | 173,369百万円 |
4. 三井信託銀行株式会社との合併に伴い引き継いだ資産及び負債の主な内訳は、次のとおりであります。
- | | |
|---------|---------------|
| 資産 | 9,644,534百万円 |
| （うち有価証券 | 3,182,350百万円） |
| （うち貸出金 | 4,893,476百万円） |
| 負債 | 9,156,909百万円 |
| （うち預金 | 4,152,420百万円） |
| （うち借入金 | 386,457百万円） |
5. 重要な非資金取引の内容は、次のとおりであります。
- | | |
|--------------------|----------|
| 転換社債の転換による資本金増加額 | 986百万円 |
| 転換社債の転換による資本準備金増加額 | 986百万円 |
| 転換による転換社債減少額 | 1,972百万円 |

連結財務諸表作成の基本となる事項

1. 連結の範囲に関する事項

(1) 連結される子会社及び子法人等 21社

主要な会社名

Chuo Mitsui Trust International Ltd.

Chuo Mitsui Trust Company (U.S.A.)

三信リース株式会社

中信リース株式会社

中央三井カード株式会社

中央三井アセットマネジメント株式会社

中央三井信用保証株式会社

なお、連結される子会社及び子法人等21社のうち三信リース株式会社他11社は、三井信託銀行株式会社との合併により期首に引き継いだ連結子会社16社から当連結会計年度において合併、営業譲渡を行った4社を除いたものであり、中央三井ステート・ストリート・アドバイザーズ株式会社及び中央三井ローンビジネス株式会社は設立により当連結会計年度から連結しております。

CTBL (Panama) S.A.及び Westcoast DL Corporation は、清算等により除外しております。

また、中信事務サービス株式会社及び株式会社ティーエイチティークレジットは、当連結会計年度において中央三井ビジネス株式会社及び中央三井信用保証株式会社とそれぞれ合併いたしました。

(2) 非連結の子会社及び子法人等

主要な会社名

中央三井クリエイト株式会社

非連結の子会社及び子法人等は、その資産、経常収益、当期純損益（持分に見合う額）及び剰余金（持分に見合う額）からみて、連結の範囲から除いても企業集団の財政状態及び経営成績に関する合理的な判断を妨げない程度に重要性が乏しいため、連結の範囲から除外しております。

2. 持分法の適用に関する事項

(1) 持分法適用の非連結の子会社及び子法人等、関連法人等

該当ありません。

(2) 持分法非適用の非連結の子会社及び子法人等、関連法人等

主要な会社名

中央三井クリエイト株式会社

持分法非適用の非連結の子会社及び子法人等、関連法人等は、当期純損益（持分に見合う額）及び剰余金（持分に見合う額）からみて、持分法の対象から除いても連結財務諸表に重要な影響を与えないため、持分法の対象から除いております。

3. 連結される子会社及び子法人等の事業年度等に関する事項

(1) 連結される子会社及び子法人等の決算日は次のとおりであります。

12月末日 6社

3月末日 15社

(2) 連結財務諸表の作成に当っては、いずれもそれぞれの決算日の財務諸表により連結しております。

連結決算日と上記の決算日との間に生じた重要な取引については、必要な調整を行っております。

4. 利益処分項目等の取扱いに関する事項

連結剰余金計算書は、連結会計期間において確定した利益処分に基づいて作成しております。

セグメント情報

中央三井信託銀行株式会社

1. 事業の種類別セグメント情報

当連結会計年度(自平成12年4月1日 至平成13年3月31日)

(単位:百万円)

	信託銀行業	金融関連業 その他	計	消去又は全社	連 結
I 経 常 収 益					
(1)外部顧客に対する経常収益	594,560	52,061	646,622	—	646,622
(2)セグメント間の内部経常収益	3,011	5,127	8,139	(8,139)	—
計	597,572	57,189	654,762	(8,139)	646,622
経 常 費 用	544,746	55,754	600,501	(8,042)	592,459
経常利益(△は経常損失)	52,825	1,434	54,260	(△97)	54,163
II 資 産	13,806,901	226,087	14,032,988	(144,992)	13,887,995
減 価 償 却 費	10,098	28,951	39,050	—	39,050
資 本 的 支 出	60,522	29,185	89,708	—	89,708

(注)1. 記載金額は百万円未満を切り捨てて表示しております。

2. 業務区分は、連結会社の主たる事業の内容により区分しております。「金融関連業その他」は、信用保証、リース、クレジット・カード業務等であります。

3. 一般企業の売上高及び営業利益に代えて、それぞれ経常収益及び経常利益を記載しております。

前連結会計年度(自平成11年4月1日 至平成12年3月31日)

(旧中央信託銀行)

(単位:百万円)

	信託銀行業	金融関連業	その他	計	消去又は全社	連 結
I 経 常 収 益						
(1)外部顧客に対する経常収益	324,268	18,316	981	343,566	—	343,566
(2)セグメント間の内部経常収益	1,251	2,439	4,826	8,517	(8,517)	—
計	325,519	20,756	5,808	352,084	(8,517)	343,566
経 常 費 用	289,677	20,092	5,418	315,188	(8,517)	306,670
経常利益(△は経常損失)	35,842	663	389	36,895	(—)	36,895
II 資 産	5,458,923	39,123	6,094	5,504,142	(31,041)	5,473,101
減 価 償 却 費	1,517	6,331	72	7,921	(—)	7,921
資 本 的 支 出	12,980	8,660	16	21,657	(—)	21,657

(旧三井信託銀行)

(単位:百万円)

	信託銀行業	金融関連業 その他	計	消去又は全社	連 結
I 経 常 収 益					
(1)外部顧客に対する経常収益	621,252	43,077	664,329	—	664,329
(2)セグメント間の内部経常収益	2,319	2,107	4,427	(4,427)	—
計	623,571	45,184	668,756	(4,427)	664,329
経 常 費 用	506,789	42,778	549,567	(3,689)	545,878
経常利益(△は経常損失)	116,782	2,406	119,188	(△737)	118,451
II 資 産	9,722,930	215,064	9,937,995	(113,559)	9,824,436
減 価 償 却 費	5,683	20,986	26,669	(—)	26,669
資 本 的 支 出	9,976	27,938	37,914	(—)	37,914

2. 所在地別セグメント情報

当連結会計年度(自平成12年4月1日 至平成13年3月31日)

全セグメントの経常収益の合計及び全セグメントの資産の金額の合計額に占める本邦の割合が 90%を超えているため、所在地別セグメント情報の記載を省略しております。

前連結会計年度(自平成11年4月1日 至平成12年3月31日)

(旧中央信託銀行)

(単位:百万円)

	日 本	そ の 他	計	消去又は全社	連 結
I 経 常 収 益					
(1)外部顧客に対する経常収益	341,978	1,588	343,566	—	343,566
(2)セグメント間の内部経常収益	1,785	1,012	2,797	(2,797)	—
計	343,763	2,601	346,364	(2,797)	343,566
経 常 費 用	306,214	3,254	309,468	(2,797)	306,670
経常利益(△は経常損失)	37,549	△ 653	36,895	(—)	36,895
II 資 産	5,469,087	10,912	5,479,999	(6,898)	5,473,101

(旧三井信託銀行)

全セグメントの経常収益の合計及び全セグメントの資産の金額の合計額に占める本邦の割合が90%を超えているため、所在地別セグメント情報の記載を省略しております。

3. 国際業務経常収益

(単位:百万円)

期 別	国際業務経常収益	連 結 経 常 収 益	国際経常収益の連結 経常収益に占める割合
当連結会計年度 自平成12年 4月 1日 至平成13年 3月31日	80,355	646,622	12.4%

(注) 1. 一般企業の海外売上高に代えて、国際業務経常収益を記載しております。

2. 国際業務経常収益は、国内での外貨建諸取引、円建貿易手形取引、円建対非居住者取引、特別国際金融取引勘定における諸取引、並びに海外連結子会社の取引に係る経常収益(ただし、連結会社間の内部経常収益は除く。)で、こうした膨大な取引を相手先別に区分していないため、国又は地域毎のセグメント情報は記載しておりません。

前連結会計年度(自平成11年4月1日 至平成12年3月31日)

(旧中央信託銀行)

(単位:百万円)

期 別	海外経常収益	連 結 経 常 収 益	海外経常収益の連結 経常収益に占める割合
前連結会計年度 自平成11年 4月 1日 至平成12年 3月31日	1,588	343,566	0.4%

(旧三井信託銀行)

(単位:百万円)

期 別	国際業務経常収益	連 結 経 常 収 益	国際経常収益の連結 経常収益に占める割合
前連結会計年度 自平成11年 4月 1日 至平成12年 3月31日	169,944	664,329	25.6%

生産、受注及び販売の状況

銀行業における業務の特殊性のため、該当する情報がないので記載しておりません。

(有 価 証 券 関 係)

【当連結会計年度】

中央三井信託銀行株式会社

(注)連結貸借対照表の「有価証券」のほか、「特定取引資産」中の商品有価証券及びコマーシャル・ペーパーが含まれております。

1. 有 価 証 券

(1) 売買目的有価証券

(単位:百万円)

期 別 種 類	当連結会計年度末 (平成13年3月31日現在)	
	連結貸借対照表計上額	当連結会計年度の損益 に含まれた評価差額
売買目的有価証券	1,389	0

(2) 満期保有目的の債券で時価のあるもの

(単位:百万円)

期 別 種 類	当連結会計年度末 (平成13年3月31日現在)				
	連 結 貸 借 対 照 表 計 上 額	時 価	差 額	うち益	うち損
国 債	77,396	76,938	△ 457	264	722
地 方 債	56,722	61,755	5,032	5,033	1
社 債	14,662	15,575	913	916	3
そ の 他	-	-	-	-	-
合 計	148,782	154,269	5,487	6,214	726

(注)時価は、当連結会計年度末日における市場価格等に基づいております。

(3) その他有価証券で時価のあるもの

当連結会計年度においては、その他有価証券のうち時価のあるものについて、時価評価を行っておりません。

なお、その他有価証券で時価のあるものに係る連結貸借対照表計上額等は次のとおりであります。

(単位:百万円)

期 別 種 類	当連結会計年度末 (平成13年3月31日現在)				
	連 結 貸 借 対 照 表 計 上 額	時 価	差 額	うち益	うち損
株 式	1,864,285	1,758,452	△105,832	130,713	236,546
債 券	1,498,852	1,513,197	14,344	15,568	1,223
国 債	1,168,369	1,173,092	4,723	5,929	1,205
地 方 債	44,277	45,935	1,657	1,658	0
社 債	286,205	294,169	7,963	7,981	17
そ の 他	635,896	578,179	△ 57,716	3,885	61,602
合 計	3,999,035	3,849,830	△149,205	150,167	299,373

(注)時価は、当連結会計年度末日における市場価格等に基づいております。

(4) 当該連結会計年度中に売却したその他有価証券

(単位:百万円)

期 別 種 類	当連結会計年度 (自平成12年4月1日至平成13年3月31日)		
	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
その他有価証券	8,254,565	109,965	12,229

(5) 時価のない有価証券の主な内容及び連結貸借対照表計上額

(単位:百万円)

種 類	当連結会計年度末 (平成13年3月31日現在)
その他有価証券	
非上場株式(店頭売買株式を除く)	55,326
非上場外国証券	21,705
出資証券	6,209

(6) その他有価証券のうち満期があるもの及び満期保有目的の債券の償還予定額

(単位:百万円)

種 類	期 別	当連結会計年度末 (平成13年3月31日現在)			
		1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
債 券		556,247	522,065	317,021	252,300
	国 債	493,527	233,334	266,604	252,300
	地 方 債	25,660	40,278	35,062	—
	社 債	37,059	248,453	15,354	—
そ の 他		23,923	253,621	68,648	138,227
合 計		580,170	775,686	385,669	390,527

2. 金 銭 信 託

(1) 運用目的の金銭の信託

(単位:百万円)

種 類 \ 期 別	当連結会計年度末 (平成13年3月31日現在)	
	連結貸借対照表計上額	当連結会計年度の損益 に含まれた評価差額
運用目的の金銭の信託	86,230	△ 825

(2) 満期保有目的の金銭の信託

該当ありません。

(3) その他の金銭の信託 (運用目的及び満期保有目的以外)

当連結会計年度においては、その他の金銭の信託のうち時価のあるものについて、時価評価を行っておりません。

なお、その他の金銭の信託に係る連結貸借対照表計上額等は次のとおりであります。

(単位:百万円)

種 類	期 別	当連結会計年度末 (平成13年3月31日現在)			
		連 結 貸 借 対 照 表 計 上 額	時 価	差 額	
その他の金銭の信託		8,505	12,249	3,743	うち益
					うち損
					—

(注) 時価は、当連結会計年度末日における市場価格等に基づいております。

3. その他有価証券評価差額金相当額

当連結会計年度において、その他有価証券及びその他の金銭の信託について時価評価を行った場合における

その他有価証券評価差額金相当額は次のとおりであります。

(単位:百万円)

		当連結会計年度末 (平成13年3月31日現在)
差額(時価－連結貸借対照表計上額)		△145,461
その他有価証券	その他有価証券	△149,205
	その他の金銭の信託	3,743
繰延税金資産相当額		56,814
その他有価証券評価差額金相当額(持分相当額調整前)		△ 88,646
(△)少数株主持分相当額		2,302
その他有価証券評価差額金相当額		△ 90,948

【前連結会計年度】

1. 有価証券の時価等

(単位:百万円)

期 別 種 類		前連結会計年度末(平成12年3月31日現在)				
		連結貸借 対照表価額	時 価	評価損益		
					うち評価益	うち評価損
有 価 証 券	債 券	865,270	836,320	△ 28,949	1,034	29,984
	株 式	2,175,857	2,087,128	△ 88,729	265,810	354,539
	そ の 他	200,527	184,997	△ 15,530	893	16,423
	合 計	3,241,655	3,108,445	△133,209	267,738	400,947

(注)1. 本表記載の有価証券は、上場有価証券(債券は、国債、地方債、社債であります。)を対象としております。

なお、上場債券の時価は、主として東京証券取引所の最終価格又は日本証券業協会が発表する公社債店頭(基準)気配表に掲載されている銘柄の利回りに基づいて計算した価格によっております。その他の上場有価証券の時価は、主として東京証券取引所の最終価格によっております。

2. 非上場有価証券のうち時価相当額として価格等の算定が可能なものは、次のとおりであります。

(単位:百万円)

期 別 種 類		前連結会計年度末(平成12年3月31日現在)				
		連結貸借 対照表価額	時価相当額	評価損益		
					うち評価益	うち評価損
有 価 証 券	債 券	576,939	578,140	1,200	5,059	3,858
	株 式	16,515	28,470	11,955	14,693	2,738
	そ の 他	380,250	366,163	△ 14,087	8,435	22,522
	合 計	973,705	972,774	△ 930	28,188	29,119

非上場有価証券の時価相当額は、店頭売買有価証券については日本証券業協会が公表する売買価格等、公募債券については日本証券業協会が発表する公社債店頭(基準)気配表に掲載されている銘柄の利回りに基づいて計算した価格、証券投資信託の受益証券については基準価格、米国の店頭売買有価証券については全米証券業協会のNASDAQによる売買価格等によっております。

3. 本表に記載の「その他」は、主として外国債券であります。上記(注)2. 記載の「その他」は、証券投資信託の受益証券及び外国債券であります。

4. 時価情報開示対象有価証券から除いた有価証券の連結貸借対照表価額は、次のとおりであります。

(単位:百万円)

期 別 種 類		前連結会計年度末 (平成12年3月31日現在)
有 価 証 券	債 券	329,679
	株 式	71,383
	そ の 他	360,217

5. 特定取引勘定に経理しております商品有価証券及び特定取引有価証券につきましては、時価評価を行い、当該評価損益を連結損益計算書に計上しておりますのでここでの記載を省略しております。

2. 金銭の信託の時価等

(単位:百万円)

期 別 種 類		前連結会計年度末(平成12年3月31日現在)				
		連結貸借 対照表価額	時価等	評価損益		
					うち評価益	うち評価損
金 銭 の 信 託		160,492	170,783	10,291	13,742	3,451

(注)時価等の算定は、以下により金銭の信託の受託者が合理的に算出した価格によっております。

1. 上場有価証券については、主として東京証券取引所における最終の価格又は日本証券業協会が発表する公社債店頭(基準)気配表に掲載されている銘柄の利回りに基づいて計算した価格によっております。
2. 店頭売買株式については、日本証券業協会が公表する売買価格等によっております。

(デリバティブ取引関係)

中央三井信託銀行株式会社

【当連結会計年度】

1. 金利関連取引

(単位:百万円)

区分	種 類	当連結会計年度(平成13年3月31日現在)			
		契約額等	うち1年超	時価	評価損益
取引所	金利先物				
	売建	67,479	-	△73	△73
	買建	71,938	-	49	49
	金利オプション				
	売建	430,000	-	160	△28
店頭	買建	100,000	-	64	47
	金利スワップ				
	受取固定・支払変動	4,066,125	2,704,855	128,862	128,862
	受取変動・支払固定	4,181,503	2,540,006	△137,402	△137,402
	受取変動・支払変動	2,500	-	-	-
	キャップ				
	売建	69,284	800	55	423
	買建	90,085	30,000	57	△616
	その他				
	売建	131,500	80,000	2,990	△683
	買建	5,000	-	5	△27
合 計				134,332	△9,449

(注) 1. 上記取引については時価評価を行い、評価損益を連結損益計算書に計上しております。
 なお、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. 時価の算定

取引所取引につきましては、東京金融先物取引所等における最終の価格によっております。
 店頭取引につきましては、割引現在価値やオプション価格計算モデル等により算定しております。

2. 通貨関連取引

通貨スワップ取引については「銀行業において『新外為経理基準』を継続適用した場合の当面の監査上の取扱い」(日本公認会計士協会平成12年4月10日)に基づき、期間損益計算を行っております。

期間損益計算を行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。

(単位:百万円)

種 類	当連結会計年度(平成13年3月31日現在)		
	契約額等	時価	評価損益
通貨スワップ	692,366	△4,934	△4,934

(注) 時価の算定は、割引現在価値等により行っております。

また、同様に、先物為替予約、通貨オプション等のうち、連結会計年度末日に引直しを行い、その損益を連結損益計算書に計上しているもの、及び外貨建金銭債権債務等に付されたもので当該外貨建金銭債権債務等の連結貸借対照表表示に反映されているもの又は当該外貨建金銭債権債務等が連結手続上消去されたものについては、上記記載から除いております。

引直しを行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。

(単位:百万円)

区分	種 類	当連結会計年度 (平成13年3月31日現在)
		契約額等
店頭	為替予約	
	売建	510,210
	買建	470,622
	通貨オプション	
	売建	176,958
	買建	161,252

3. 株式関連取引

(単位:百万円)

区分	種 類	当連結会計年度(平成13年3月31日現在)			
		契約額等	うち1年超	時価	評価損益
店頭	有価証券店頭指数等スワップ				
	株価指数変化率受取・短期変動金利支払	34,779	-	33,683	△1,095
	短期変動金利受取・株価指数変化率支払	-	-	-	-
合 計				33,683	△1,095

(注) 1. 上記取引については時価評価を行い、評価損益を連結損益計算書に計上しております。
 なお、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. 時価の算定

取引所取引につきましては、東京証券取引所等における最終の価格によっております。
 店頭取引につきましては、割引現在価値やオプション価格計算モデル等により算定しております。

4. 債券関連取引

(単位:百万円)

区分	種 類	当連結会計年度(平成13年3月31日現在)			
		契約額等	うち1年超	時価	評価損益
取引所	債券先物				
	売建	-	-	-	-
	買建	4,311	-	△2	△2
合 計				△2	△2

(注) 1. 上記取引については時価評価を行い、評価損益を連結損益計算書に計上しております。
 なお、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. 時価の算定

取引所取引につきましては、東京証券取引所等における最終の価格によっております。
 店頭取引につきましては、オプション価格計算モデル等により算定しております。

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。

関連当事者との取引

当連結会計年度(自平成12年4月1日 至平成13年3月31日)

関連当事者との取引について記載すべき重要なものはありません。

【前連結会計年度】

中央三井信託銀行株式会社

デリバティブ取引の評価損益等

(1) 金利関連取引

(単位:百万円)

区 分	種 別		前連結会計年度末(平成12年3月31日現在)				
			契 約 額 等		時 価	評 価 損 益	
							うち1年超
取 引 所	金利 先物	売 建	—	—	—	—	
		買 建	—	—	—	—	
	金利 オ プ シ ョ ン	売	コ ー ル	—	—	—	—
			(—)		—	—	
			プ ッ ト	—	—	—	—
			(—)		—	—	
		買	コ ー ル	—	—	—	—
			(—)		—	—	
			プ ッ ト	—	—	—	—
			(—)		—	—	
店 							

(注) 1. 時価の算定

取引所取引につきましては、東京金融先物取引所等における最終の価格によっております。

店頭取引については、割引現在価値やオプション価格計算モデル等により算定しております。

2. ()内は連結貸借対照表に計上したオプション料であります。

3. 特定取引(トレーディング取引)に含まれますデリバティブ取引につきましては、時価評価を行い、その評価損益を連結損益計算書に計上しておりますので上記記載から除いております。
 特定取引に含まれます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。

(単位:百万円)

区分	種 類		前連結会計年度末 (平成12年3月31日現在)	
			契約額等	時 価
取引所	金利先物	売 建	102,945	102,958
		買 建	24,587	24,588
	金利オプション	コ ー ル	140,000	50
			(58)	
		プ ッ ト	781,600	66
			(193)	
		コ ー ル	655,000	119
			(171)	
		プ ッ ト	435,000	68
			(144)	
店頭	金利先渡契約	売 建	—	—
		買 建	—	—
	金利スワップ	受取固定・支払変動	1,055,469	3,398
		受取変動・支払固定	1,112,224	△ 2,406
		受取変動・支払変動	150	△ 0
	金利オプション	コ ー ル	—	—
			(—)	
		プ ッ ト	—	—
			(—)	
		コ ー ル	—	—
			(—)	
		プ ッ ト	—	—
			(—)	
	キャップ	売 建	11,999	43
			(131)	
		買 建	8,855	26
			(91)	
	フロアー	売 建	—	—
			(—)	
		買 建	2,060	60
			(26)	
	その他	売 建	45,768	276
			(413)	
		買 建	50,317	393
			(542)	

(注) ()内は、契約額等に係る当初の受払オプション料であります。

(2) 通貨関連取引

(単位:百万円)

区分	種 類	前連結会計年度末(平成12年3月31日現在)			
		契約額等		時 価	評価損益
			うち1年超		
店頭	通貨スワップ	875,355	116,288	△ 7,324	△ 7,324
	うち米ドル	802,301	116,288	△ 7,216	△ 7,216
	うち英ポンド	7,612	—	△ 46	△ 46
	うち独マルク	54,650	—	△ 39	△ 39
	うちその他	10,791	—	△ 22	△ 22

(注) 1. 時価の算定

割引現在価値により算定しております。

2. 特定取引に含まれますデリバティブ取引の契約額等はございません。

3. 先物為替予約、通貨オプション等のうち、連結会計年度末日に引直しを行い、その損益を連結損益計算書に計上しているもの、及び外貨建金銭債権債務等に付されたもので当該外貨建金銭債権債務等の連結貸借対照表表示に反映されているもの又は当該外貨建債権債務等が連結手続上消去されたものについては、上記記載から除いております。

引直しを行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。

(単位:百万円)

区分	種 類		前連結会計年度末 (平成12年3月31日現在)	
			契 約 額 等	
取引所	通貨先物	売 建	—	
		買 建	—	
	通貨オプション	売	コール	—
			(	—)
		建	プット	—
			(	—)
		買	コール	—
			(	—)
		建	プット	—
			(	—)
店頭	為替予約	売 建	775,151	
		買 建	803,156	
	通貨オプション	売	コール	3,980
			(	46)
		建	プット	5,042
			(	66)
		買	コール	3,980
			(	46)
		建	プット	5,042
			(	66)
	その他	売 建	—	
		買 建	—	

(注) ()内は、連結貸借対照表に計上したオプション料であります。

(3) 株式関連取引

該当ありません。

(4) 債券関連取引

(単位: 百万円)

(単位:百万円)

区 分	種 類			前連結会計年度末(平成12年3月31日現在)			
				契約額等		時 価	評価損益
取 引 所	債 券 先 物	売 建 買 建	131,464	—	131,500	△ 35	
			2,239	—	2,235	△ 3	
	債 券 先 物 オ プ シ ョ ン	売	コール	—	—	—	—
				(—)		—	—
			プット	—	—	—	—
				(—)		—	—
		建 買	コール	—	—	—	—
				(—)		—	—
			プット	—	—	—	—
				(—)		—	—
店 頭	債 券 店 頭 オ プ シ ョ ン	売	コール	—	—	—	—
				(—)		—	—
			プット	—	—	—	—
				(—)		—	—
		建 買	コール	—	—	—	—
				(—)		—	—
			プット	—	—	—	—
				(—)		—	—
	その他	売 建	—	—	—	—	
		買 建	—	—	—	—	
合 計						△ 38	

(注) 1. 時価の算定

取引所取引につきましては、東京証券取引所等における最終の価格によっております。

店頭取引については、オプション価格計算モデル等により算定しております。

2. () 内は連結貸借対照表に計上したオプション料であります。

3. 特定取引(トレーディング取引)に含まれますデリバティブ取引につきましては、時価評価を行い、その評価損益を連結損益計算書に計上しておりますので、上記記載から除いております。
特定取引に含まれます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。

(単位:百万円)

区分	種類		前連結会計年度末 (平成12年3月31日現在)	
			契約額等	時 価
取引所	債券先物	売 建	—	—
		買 建	—	—
	債券先物オプション	売	コール	—
			(—)	—
		プット	—	—
			(—)	—
		買	コール	—
			(—)	—
		プット	—	—
			(—)	—
店頭	債券店頭オプション	売	コール	—
			(—)	—
		プット	—	—
			(—)	—
		買	コール	—
			(—)	—
		プット	—	—
			(—)	—
	その他	売 建	—	—
		買 建	—	—

(注) ()内は、契約額等に係る当初の受払オプション料であります。

- (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。