

各 位

会社名 三井トラスト・ホールディングス株式会社
(コード番号 8309)

平成15年3月期第1四半期情報の開示について

当社ならびに当社子会社(中央三井信託銀行・三井アセット信託銀行)の平成15年3月期第1四半期(平成14年4月1日から平成14年6月30日)における四半期情報について、お知らせいたします。

下記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」および金融庁「証券市場の構造改革プログラム」の趣旨等を踏まえ、当四半期から任意の会社情報として開示するものです。

(注)下記記載の各計数については監査法人による監査を受けておりません。

記

1. 金融再生法ベースのカテゴリーによる開示

【中央三井】【単体】

	(単位:億円)	(参考) (単位:億円)
	平成14年6月末	平成14年3月末
破産更生債権及びこれらに準ずる債権	1,318	1,333
銀行勘定	909	885
信託勘定	409	448
危険債権	2,934	3,193
銀行勘定	2,609	2,841
信託勘定	324	352
要管理債権	5,140	5,042
銀行勘定	4,606	4,502
信託勘定	533	539
合計	9,393	9,569
銀行勘定	8,125	8,228
信託勘定	1,267	1,340

(注)上記の平成14年6月末の計数は、「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が、集計方法については以下の点につき年度末に開示する計数とは異なるため、計数は連続しておりません。

- 平成14年6月末の「破産更生債権及びこれらに準ずる債権」および「危険債権」の金額は、同年3月末時点における金額(債務者区分()残高)をベースとし、同年3月末から6月末までに倒産、不渡り等客観的な事実ならびに中央三井の内部格付の引下げ等があった債務者について、同社の定め

る自己査定基準に基づき債務者区分の見直しを行ない、債務者区分が下方に変更になったと認められる債務者に対する債権額を新たに加算、または「危険債権」を減算し「破産更生債権及びこれらに準ずる債権」を加算しております。

また、平成14年6月末の債権額については四半期中の残高増減額を反映し、同年3月末時点の開示区分別の大口先上位30社に対する債権のうち直接償却相当額を減額しております。

なお、新たに「破産更生債権及びこれらに準ずる債権」と認められる金額のうち、無価値と認められる部分については直接償却相当額として当該金額を減額しております。

債務者区分との関係： 破産更生債権及びこれらに準ずる債権（実質破綻先、破綻先の債権）
危険債権（破綻懸念先の債権）
要管理債権（要注意先のうち、利払いが3ヵ月以上延滞しているか、又は貸出条件を緩和している債権）

2. 平成14年6月末の「要管理債権」の金額は、同様に、同年3月末時点における金額をベースとし、同年3月末から6月末の間に正常先、要注意先の債務者に対する債権のうち新たに3ヵ月以上延滞となった債権、新たに貸出条件を緩和したことを確認している債権を加算し、「破産更生債権及びこれらに準ずる債権」および「危険債権」に変更になった金額を減算しております。また、平成14年3月末時点に開示した債権額については、四半期中の残高増減額を反映しております。
3. 当社および三井アセットにおいて対象となる債権はありません。

2. 自己資本比率（国内基準）

	平成14年9月末（予想値）		平成14年3月末（実績値）	
	三井トラスト連結	中央三井連結	三井トラスト連結	中央三井連結
自己資本比率	10%後半	10%半ば	10.59%	10.11%
Tier 1比率	5%後半	5%半ば	5.39%	5.06%

(注)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。

3. 時価のある有価証券の評価差額

【中央三井】【単体】

	(単位：億円)				(参考) (単位：億円)			
	平成14年6月末				平成14年3月末			
	時価	評価差額	うち益	うち損	時価	評価差額	うち益	うち損
其他有価証券	34,810	149	1,074	1,223	31,043	4	827	832
株式	12,669	218	904	1,122	12,966	51	720	668
債券	20,237	143	153	9	14,943	53	94	40
その他	1,903	74	16	91	3,133	109	13	123

- (注) 1. 平成14年6月末の「評価差額」および「含み損益」は、平成14年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。
2. 有価証券のほかコマーシャル・ペーパーも含めております。
3. 満期保有目的の債券、および子会社・関連会社株式で時価のあるものはありません。
4. 株式ならびに投資信託については、月末日前1カ月の市場価格の平均の価額を時価としております。
5. 三井アセットにおいては債券のみ保有しており、平成14年6月末の時価は860億円、評価差額は0億円、うち益は0億円、うち損は0億円であります。また、当社においては時価のある有価証券は保有しておりません。

4. デリバティブ取引の状況

【中央三井】【単体】

(1) 金利関連取引

	(単位：億円)			(参考) (単位：億円)		
	平成14年6月末			平成14年3月末		
	契約額等	時価	評価差額	契約額等	時価	評価差額
金利関連取引		7	8		27	44
取引所	6,169	1	1	37	0	0
店頭 (うち金利スワップ)	67,597 (65,140)	8 (11)	7 (11)	77,541 (74,929)	27 (48)	44 (48)

- (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. 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

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以下のとおりであります。

	(単位：億円)			(参考) (単位：億円)		
	平成14年6月末			平成14年3月末		
	契約額等	時価	評価差額	契約額等	時価	評価差額
通貨スワップ	3,917	18	18	5,162	15	15

- (注) 1. 時価の算定につきましては、割引現在価値等により算定しております。

事業年度末に引直しを行っている先物為替予約、通貨オプション等の契約額等は以下のとおりであります。

	(単位：億円)		(参考)(単位：億円)	
	平成14年6月末		平成14年3月末	
	契約額等		契約額等	
為替予約	9,205		9,623	
通貨オプション	842		920	

(3) 株式関連取引

該当ありません。

(4) 債券関連取引

	(単位：億円)			(参考)(単位：億円)		
	平成14年6月末			平成14年3月末		
	契約額等	時価	評価差額	契約額等	時価	評価差額
債券関連取引		0	0		0	0
取引所	1,036	0	0	20	0	0
店頭						

(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. 時価の算定につきましては、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。

(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。

(注) 当社および三井アセットにおいては上記(1)～(6)に該当する取引はありません。

以上