

平成15年7月25日

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16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16年3月期第1四半期（平成15年4月1日から平成15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。

(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による開示

【中央三井】 【単体】

				(単位:億円)		(参考) (単位:億円)
				平成15年6月末	平成14年12月末	平成15年3月末
破産更生債権及びこれらに準ずる債権				867	1,080	779
銀 行 勘 定	信 託 勘 定	危 険 債 権		731	844	598
				136	236	181
銀 行 勘 定	信 託 勘 定	要 管 理 債 権		2,134	2,771	2,138
				1,940	2,523	1,968
銀 行 勘 定	信 託 勘 定	合 計		194	247	169
				3,976	3,789	4,106
銀 行 勘 定	信 託 勘 定			3,422	3,264	3,554
				554	525	551
銀 行 勘 定	信 託 勘 定			6,978	7,641	7,023
				6,093	6,632	6,121
銀 行 勘 定	信 託 勘 定			884	1,009	902

(注) 上記の平成15年6月末・平成14年12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。

1. 平成15年6月末・平成14年12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、それぞれ同年3月末・9月末時点における金額(債務者区分(※)残高)をベースとし、各四半期中に倒産、不渡り等客観的な事実ならびに中央三井信託銀行の内部格付の引下げ等があった債務者について、中央三井信託銀行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」を減額し「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。同様に、債務者区分が上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減額しております。

また、平成15年6月末・平成14年12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、それぞれ同年3月末・9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等

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」と認められた金額のうち、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15年6月末・平成14年12月末の「要管理債権」の金額は、同様に、それぞれ同年3月末・9月末時点における金額をベースとし、四半期中に正常先、要注意先の債務者に対する債権のうち①新たに3ヵ月以上延滞となった債権、②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」、「危険債権」に変更になった債権および「要管理債権」に該当しないことを確認している債権を減算しております。また、平成15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信託銀行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15年9月末（予想値）		(参考) 平成15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	8%台半ば	8%程度	7.50%	6.55%
Tier 1比率	4%台半ば	4%程度	3.75%	3.28%

(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15年3月末									
										平成14年12月末									
										平成15年6月末									
										時価		評価差額		時価		評価差額			
												うち益		うち損		うち益		うち損	
その他有価証券	33,268	△1,299	602	1,902	25,979	△1,899	422	2,321	28,827	△1,449	429	1,879							
	株 式	8,275	△908	528	1,436	9,251	△1,930	267	2,197	7,856	△1,551	234	1,786						
	債 券	22,491	△369	58	428	15,140	90	130	39	18,430	129	180	50						
	そ の 他	2,501	△21	15	36	1,587	△60	24	84	2,539	△27	13	41						

(注) 1. 平成15年6月末の「評価差額」および「含み損益」は、平成15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。平成14年12月末の「評価差額」および「含み損益」は平成14年12月末時点の帳簿価額（償却原価法適用前、14年上期減損処理額反映後）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ヵ月の市場価格の平均の時価を時価としております。

5. 三井アセット信託銀行においては債券のみ保有しており、平成15年6月末の時価は1,422億円、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)		
							平成15年3月末		
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
							契約額等	時価	評価差額
</									

(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

		(単位：億円)						(参考) (単位：億円)
区分	種類	平成15年6月末			平成14年12月末			平成15年3月末
		契約額等	時価	評価差額	契約額等	時価	評価差額	契約額等
取引所	通貨先物	—	—	—	—	—	—	—
	通貨スワップ	1,457	△2	△2	—	—	—	—
店頭	為替予約	13,814	5	5	—	—	—	—
	通貨オプション	1,214	10	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3. の取引は、上記記載から除いております。

2. 従来、引き直し対象の先物為替予約、通貨オプション等は、当四半期からは上記に含めて記載しております。

3. 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、下記の通りであります。

なお従来、期間損益計算を行っていた通貨スワップ取引は、当四半期からはヘッジ会計を適用しておりますので、下記記載から除いております。

種類	(単位：億円)			(参考) (単位：億円)
	平成14年12月末			平成15年3月末
	契約額等	時価	評価差額	契約額等
通貨スワップ	3,408	△10	△10	3,525
				△18

また、先物為替予約、通貨オプション等のうち、引き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。

区分	種類	(単位：億円)	(参考) (単位：億円)
		平成14年12月末	平成15年3月末
取引所	通貨先物	—	—
	通貨スワップ	—	—
店頭	為替予約	8,971	9,065
	通貨オプション	1,246	555

(3) 株式関連取引

(単位：億円)							(参考)	(単位：億円)		
	平成15年6月末			平成14年12月末				平成15年3月末		
	契約額等	時価	評価差額	契約額等	時価	評価差額		契約額等	時価	評価差額
株式関連取引		△0	△0		0	0			△2	△2
取引所	—	—	—	—	—	—		—	—	—
店頭	78	△0	△0	59	0	0		40	△2	△2

(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。

(4) 債券関連取引

(単位：億円)							(参考)	(単位：億円)		
	平成15年6月末			平成14年12月末				平成15年3月末		
	契約額等	時価	評価差額	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			0	0
取引所	2,787	△0	△0	363	△0	△0		52	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信託銀行においては上記(1)～(6)に該当する取引はありません。

5. 保有株式の売却

【中央三井信託】 【単体】

(単位：億円)		
15年4月～6月実績	15年度計画	
	うち上期	
498	2,000	4,000

(注) 取得原価ベース

6. 預金・貸出金等の残高

【中央三井信託】 【単体】

		(単位：億円)		(参考)
		15年6月末	14年12月末	15年3月末
銀行	預金	85,619	83,351	84,618
	貸出金	71,496	75,896	71,656
金銭信託	元本	16,267	16,588	15,873
	貸出金	5,150	4,160	8,378
貸付信託	元本	24,130	28,202	26,559
	貸出金	15,341	17,257	16,315

(注)金銭信託、貸付信託は元本補てん契約のある信託

以 上