

平成16年1月27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3四半期情報の開示について

当社及び傘下銀行の平成16年3月期第3四半期(平成15年10月1日から平成15年12月31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ーによる開示
【中央三井単体】

	(単位:億円)		(参考)(単位:億円)
	平成15年12月末	平成15年6月末	平成15年9月末
破産更生債権及びこれらに準ずる債権	859	867	774
銀行勘定	716	731	632
信託勘定	143	136	141
危険債権	1,633	2,134	2,099
銀行勘定	1,355	1,940	1,925
信託勘定	277	194	173
要管理債権	3,029	3,976	3,709
銀行勘定	2,670	3,422	3,182
信託勘定	359	554	527
合 計	5,523	6,978	6,583
銀行勘定	4,742	6,093	5,741
信託勘定	780	884	842

(注) 上記の平成15年12月末・平成15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。

1. 平成15年12月末・平成15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、それぞれ同年9月末・3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、不渡り等の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し、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算しております。

また、平成15年12月末・平成15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、それぞれ同年9月末・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12月末・平成15年6月末の「要管理債権」の金額は、同様に、それぞれ同年9月末・3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」、「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9月末・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. 当社及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）

（参考）

	平成16年3月末(予想値)		平成15年9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	9%台半ば	9%程度	9.33%	8.60%
Tier 1 比率	5%程度	4%台半ば	4.86%	4.37%

(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（分離会社を含む）】

（単位：億円）（参考）（単位：億円）

	平成15年12月末				平成15年6月末				平成15年9月末			
	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	35,234	742	959	1,702	33,268	1,299	602	1,902	29,696	864	842	1,707
株式	7,122	205	915	710	8,275	908	528	1,436	7,746	120	785	665
債券	22,305	867	28	895	22,491	369	58	428	18,636	933	39	972
その他	5,806	81	15	96	2,501	21	15	36	3,314	51	17	69

(注) 1. 上記記載には分離会社であるCMTBIクイックバスターツ(株)を含めております。同社保有株式の評価差額については分離前の帳簿価額を基準として算出しております。

2. 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15年12月末の「評価差額」および「含み損益」は平成15年12月末時点の帳簿価格（償却原価法適用前、15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。

3. 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。

4. 満期保有目的の債券、子会社・関連会社株式で時価のあるものはありません。

5. 株式、投資信託については、各四半期末日前1カ月の市場価格の平均に基づいて算定された額を時価としております。

6. 三井アセット信託銀行は時価のある有価証券としては債券のみを保有しており、平成15年12月末の時価は690億円、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

(1) 金利関連取引

【中央三井単体】

（単位：億円）（参考）（単位：億円）

区分	種類	平成15年12月末			平成15年6月末			平成15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	-	5,442	0	0	15,128	0	0	247	0	0
店頭	金利スワップ	53,411	47	47	54,132	93	93	51,339	67	67
	その他	2,297	10	0	2,509	24	5	2,122	9	0
	合計		37	46		119	88		58	67

(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。

3. 当社及び三井アセット信託銀行においては該当ありません。

(2) 通貨関連取引
【中央三井単体】

(単位：億円) (参考) (単位：億円)

区分	種類	平成15年12月末			平成15年6月末			平成15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	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
店頭	通貨スワップ	2,269	4	4	1,457	2	2	1,352	2	2
	為替予約	14,752	5	5	13,814	5	5	12,643	7	7
	通貨オプション	1,205	30	0	1,214	10	0	1,364	35	1
	合計			10			2			6

(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. 当社及び三井アセット信託銀行においては該当ありません。

(3) 株式関連取引
【中央三井(分離子会社を含む)】

(単位：億円) (参考) (単位：億円)

区分	平成15年12月末			平成15年6月末			平成15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	47	2	2	-	-	-	-	-	-	
店頭	47	0	0	78	0	0	179	1	1	
	合計		3	3		0	0		1	1

(注) 1. 上記記載には分離子会社であるCMTBイクティンベストマツ(株)を含めております。

2. 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。

3. 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. 当社及び三井アセット信託銀行においては該当ありません。

(4) 債券関連取引
【中央三井単体】

(単位：億円) (参考) (単位：億円)

区分	平成15年12月末			平成15年6月末			平成15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	1,775	2	1	2,787	0	0	132	0	0
店頭	1,031	5	0	-	-	-	-	-	-
	合計		7	2		0	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。

3. 当社及び三井アセット信託銀行においては該当ありません。

(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
【中央三井単体】

(単位：億円) (参考) (単位：億円)

区分	平成15年12月末			平成15年6月末			平成15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
店頭	200	1	1	-	-	-	-	-	-

(注) 当社及び三井アセット信託銀行においては該当ありません。

5. 繰延ヘッジ会計適用デリバティブ取引の評価損益

【中央三井単体】

	(単位：億円) (参考)		(単位：億円)
	平成15年12月末	平成15年6月末	平成15年9月末
金利関連取引	8	1	24
通貨関連取引	6	9	7
株式関連取引	-	-	-
債券関連取引	-	-	-
合計	14	7	32

6. 保有株式の売却状況

【中央三井（分離子会社を含む）】

(単位：億円)		
15年4月～12月実績累計		
15年4月～9月実績	15年10月～12月実績	
2,092	687	2,779

(注) 上記記載には分離子会社であるCMTBIクイーンパースツ（株）における保有株式の売却を含めております。

7. 預金・貸出金等の残高

【中央三井単体】

		(単位：億円) (参考)		(単位：億円)
		15年12月末	15年6月末	15年9月末
銀行勘定	預金	88,472	85,619	88,409
	貸出金	71,727	71,496	72,659
金銭信託	元本	15,822	16,267	16,048
	貸出金	6,348	5,150	6,036
貸付信託	元本	21,185	24,130	22,350
	貸出金	13,811	15,341	14,442

(注) 1. 銀行勘定預金に譲渡性預金は含まれておりません。

2. 金銭信託は元本補てん契約のあるものについて記載しております。

以上