



平成19年3月期

中間決算短信（連結）

平成18年11月20日

上場会社名 三井トラスト・ホールディングス株式会社

上場取引所 東証・大証・名証 各第一部

コード番号 8309

本社所在都道府県 東京都

(URL <http://www.mitsuitrust-fg.co.jp/>)

代表者役職名 取締役社長 氏名 田辺 和夫

問合せ先責任者役職名 経営企画部 次長

氏名 鈴木 啓介 TEL (03)5232-8542

中間決算取締役会開催日 平成18年11月20日

特定取引勘定設置の有無 有

米国会計基準採用の有無 無

1. 平成18年9月中間期の連結業績（平成18年4月1日～平成18年9月30日）

(1) 連結経営成績

(注) 記載金額は百万円未満を切り捨てて表示しております。

	経常収益		経常利益		中間（当期）純利益	
	百万円	%	百万円	%	百万円	%
18年9月中間期	214,259	4.2	68,498	1.2	66,981	14.2
17年9月中間期	223,757	8.5	67,681	11.4	58,671	66.1
18年3月期	481,036		138,361		119,684	

	1株当たり 中間（当期）純利益		潜在株式調整後1株当たり 中間（当期）純利益	
	円	銭	円	銭
18年9月中間期	78	62	38	46
17年9月中間期	71	30	32	71
18年3月期	139	04	66	74

(注) 持分法投資損益 18年9月中間期 578百万円 17年9月中間期 276百万円 18年3月期 905百万円

期中平均株式数（普通株式・連結） 18年9月中間期 851,929,387株 17年9月中間期 822,823,946株 18年3月期 822,814,410株
会計処理の方法の変更 無

経常収益、経常利益、中間（当期）純利益におけるパーセント表示は、対前年中間期増減率

(2) 連結財政状態

	総 資 産	純 資 産	自己資本比率	1株当たり純資産	連結自己資本比率 (国内基準)
	百万円	百万円	%	円 銭	%
18年9月中間期	13,415,233	993,506	6.6	540 69	[速報値] 12.50
17年9月中間期	13,294,771	704,679	5.3	331 10	11.01
18年3月期	13,808,769	858,850	6.2	512 08	12.35

(注) 期末発行済株式数（普通株式・連結） 18年9月中間期 903,642,044株 17年9月中間期 822,807,535株 18年3月期 822,771,009株
「自己資本比率」は、（中間期末純資産の部合計 - 中間期末少数株主持分）を中間期末資産の部の合計で除して計算しております。
「連結自己資本比率（国内基準）」は、「銀行法第52条の25の規定に基づき自己資本比率の基準を定める件（平成10年大蔵省告示第62号）」に基づき算出しております。

(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
18年9月中間期	119,904	89,934	19,173	122,562
17年9月中間期	350,585	321,901	18,787	400,486
18年3月期	472,449	398,845	23,012	351,462

(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 27社 持分法適用非連結子会社数 -社 持分法適用関連会社数 3社

(5) 連結範囲及び持分法の適用の異動状況

連結（新規） -社（除外） -社 持分法（新規） -社（除外） -社

2. 平成19年3月期の連結業績予想（平成18年4月1日～平成19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
通 期	440,000	160,000	120,000

(参考) 1株当たり予想当期純利益（通期） 127円 84銭

本資料及び参考資料記載の業績予想に関しましては、発表日現在において入手可能な情報及び計画に基づき作成しております。実際の業績は、今後様々な要因によって、大きく異なる結果となる可能性があります。

期中平均株式数（連結）

	普通株式	第一種優先株式	第二種優先株式	第三種優先株式
18年9月中間期	851,929,387株	12,786,885株	93,750,000株	156,406,250株
17年9月中間期	822,823,946株	20,000,000株	93,750,000株	156,406,250株
18年3月期	822,814,410株	20,000,000株	93,750,000株	156,406,250株

期末発行済株式数（連結）

	普通株式	第一種優先株式	第二種優先株式	第三種優先株式
18年9月中間期	903,642,044株	-	93,750,000株	156,406,250株
17年9月中間期	822,807,535株	20,000,000株	93,750,000株	156,406,250株
18年3月期	822,771,009株	20,000,000株	93,750,000株	156,406,250株

「平成18年9月中間期の連結業績」の指標算式

$$1 \text{ 株当たり中間（当期）純利益} \cdots \frac{\text{中間（当期）純利益} - \text{優先株式配当金総額}}{\text{中間期（当期）中平均普通株式数} *}$$

潜在株式調整後1株当たり中間（当期）純利益・・・

$$\frac{\text{中間（当期）純利益} + \text{中間（当期）純利益調整額} - \text{優先株式配当金総額}}{\text{中間期（当期）中平均普通株式数} * + \text{潜在株式数}}$$

1株当たり純資産・・・

18年9月中間期

$$\frac{\text{中間期末純資産額} - \text{中間期末発行済優先株式数} \times \text{発行価額} - \text{優先株式配当金総額} - \text{少数株主持分}}{\text{中間期末発行済普通株式数} *}$$

17年9月中間期および18年3月期

$$\frac{\text{中間期（当期）末純資産額} - \text{中間期（当期）末発行済優先株式数} \times \text{発行価額} - \text{優先株式配当金総額}}{\text{中間期（当期）末発行済普通株式数} *}$$

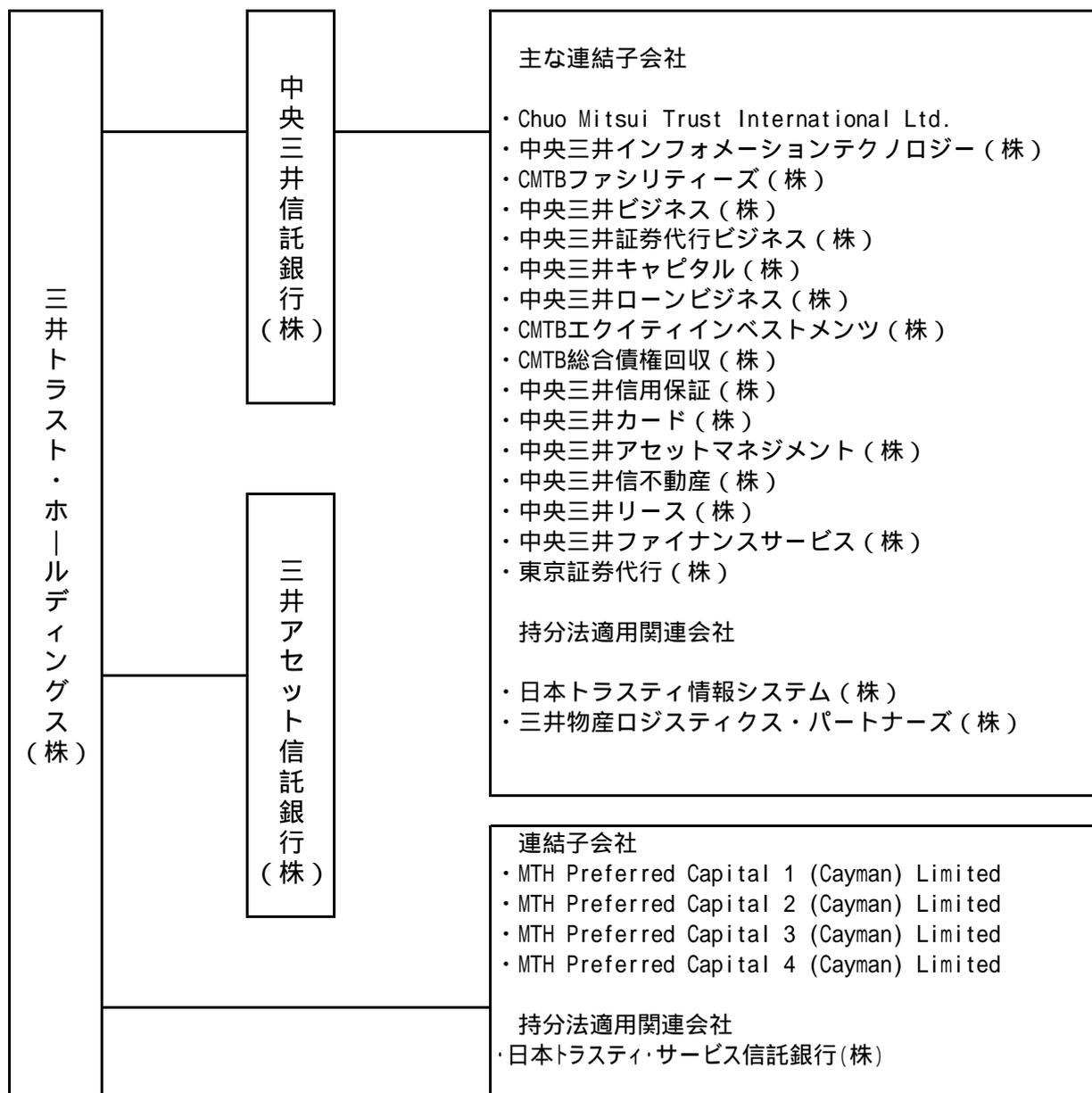
「平成19年3月期の連結業績予想」指標算式

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

*：自己株式は除く

1. 企業集団の状況

当グループは、信託銀行業務を中心に、その他金融関連業務を行っております。当社の主な関係会社を図示すると以下のとおりとなります。



2. 経営方針

(1) 経営の基本方針

当グループは以下の3点をグループの経営理念として掲げております。

金融機能と信託機能を駆使して社会のニーズに応え、国民経済の発展に寄与していきます。

企業市民としての自覚を常に持ち、その社会的責任を果たしていきます。

リスク管理体制と法令等遵守（コンプライアンス）体制の充実を図り、経営の健全性を確保していきます。

こうした経営理念の下、当グループは透明性の高い経営体制を通じて効率的に業務を推進し、収益力を強化するとともに強固な財務基盤を構築していくことを基本方針としております。

(2) 利益配分に関する基本方針

当グループは、金融機関としての公共性に鑑み適正な内部留保の充実に努めるとともに、株主への利益還元を安定的に行うことを基本方針としております。

(3) 投資単位の引下げに関する考え方および方針等

当社株式の投資単位の引下げについては、株価水準・株主数・株式の流動性および費用対効果等を勘案し、直ちに実施すべき状況にないと考えておりますが、これらの諸要素の今後の動向に加えて市場のニーズ等も考慮し、適宜検討を続けてまいります。

(4) 中長期的な経営戦略

当グループでは、リテール信託業務・バンキング業務・不動産業務・証券代行業務などを担う中央三井信託銀行と、年金信託業務・証券信託業務などを担う三井アセット信託銀行の2つの信託銀行が、それぞれの事業分野において機動的に業務を推進するとともに、様々な形で互いに連携を図り、シナジー効果を追求しております。また、持株会社である三井トラスト・ホールディングスが経営資源を各事業部門に最適に配分することで、グループ収益の極大化を目指しております。

傘下銀行における事業戦略は以下のとおりです。

中央三井信託銀行

個人取引の分野においては、お客さまのライフステージの様々な局面で、ローン、資産運用管理、資産承継などに関する適切なコンサルティングを通じて多様な商品・サービスを一元的に提供してまいります。

また、法人取引の分野においては、これまで信託銀行として培ってきたノウハウを結集した提案型の営業活動を推進し、お客さまの経営・財務戦略上のニーズに幅広くお応えしてまいります。

三井アセット信託銀行

国内外の株式・債券投資の他、代替投資などの豊富な品揃えの中から、お客さまに最適な運用商品を提供してまいります。

また、確定拠出年金や確定給付企業年金などの様々な年金制度管理に対応し、退職給付制度全般にわたるお客さまの多様なニーズにお応えしてまいります。

(5) 対処すべき課題

わが国の金融機関を取り巻く環境は、政府が進める構造改革の進展とともに、大きく変化しつつあります。当グループはこうした外部環境の変化を的確に捉え、成長分野のビジネスを増強することで収益構造の転換をさらに進め、グループ全体の業務粗利益を拡大していくことにより、収益力の強化を図ります。

まず、既存の業務分野におきましては、堅調にマーケットの拡大が続いている投信市場や不動産市場に関連する業務を重点的に強化します。

さらに、新たな収益源を確保していくために、近年取り組みを始めた中小企業のお客さま向けのビジネスローン等についても積極的に業容拡大を図ります。

一方、当グループが今後の事業展開を行っていくうえでは、リスク管理や法令等遵守の重要性がますます高まっていくものと考えられます。このため、当グループは事業に内在するリスクを的確に把握し管理するための体制を拡充していくとともに、全役職員の法令等遵守徹底に関する取り組みをより強化していきます。さらに、こうした社内の仕組みの有効性や実効性を自らがチェックする内部監査機能の充実に努め、主体的に問題を把握し改善を行っていく体制も一層強化していきます。

また、当グループではCSR（コーポレート・ソーシャル・レスポンシビリティ＝企業の社会的責任）について、グループ全体で統合的に取り組んでいく観点から、持株会社である三井トラスト・ホールディングスに、社長を委員長とする「グループCSR審議会」を設置しています。今後とも金融機関としての公共的使命を十分に意識し、グループを挙げてCSR活動を推進いたします。

3. 経営成績及び財政状態

(1) 経営成績

当中間期の経済環境を顧みますと、海外では、米国で金利上昇の影響から経済減速の兆候が見られたものの、総じて景気は拡大基調を維持しました。

わが国では、景気は内需を中心として着実に回復を続けました。設備投資など企業における回復の動きが途切れず、生産が緩やかに増加したほか、企業収益の改善が家計に好影響をもたらし、個人消費の増加が景気を下支えしました。

わが国の金融市場に目を転じますと、日本銀行のゼロ金利政策の解除を受けて、無担保コール翌日物レートは7月以降誘導目標の0.25%近辺で推移しました。長期金利は一時2.0%台に上昇したものの、9月末には利上げ観測の後退から1.6%台となりました。日経平均株価は企業収益の拡大等を背景に、期初17,000円台半ばまで上昇した後反落し、6月から7月にかけて14,000円台まで下落する局面もありましたが、夏場以降徐々に回復し9月末には16,000円台となりました。為替市場は5月に一時1ドル=109円台を付けたものの、その後は円安ドル高傾向で推移し、9月末には118円台となりました。

このような経済・金融環境のもと、当グループは収益構造の転換をさらに進め、業務粗利益を拡大していくことにより収益力の強化を図ることをグループの基本方針として掲げ、リテール信託業務、バンキング業務、不動産業務、証券代行業務などを担う中央三井信託銀行と、年金信託業務、証券信託業務などを担う三井アセット信託銀行のふたつの信託銀行を中心として、様々な活動を展開してまいりました。

当中間期の連結ベースの経営成績については、経常利益は前年同期比8億円増加し684億円、中間純利益は前年同期比83億円増加し669億円となりました。

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利益690億円、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利益240億円となりました。

平成19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4,400億円、経常利益は1,600億円、当期純利益は1,200億円を見込んでおります。

(2) 財政状態

資産負債の状況につきましては、総資産は期中3,935億円減少して13兆4,152億円、そのうち貸出金は1,574億円減少して7兆1,346億円、有価証券は1,087億円増加して3兆9,444億円となりました。また預金は1,688億円減少して8兆2,113億円となりました。

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1,199億円の支出、有価証券の取得・売却や有形固定資産の取得・売却等の投資活動によるものが899億円の支出、劣後調達等の財務活動によるものが191億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1,225億円となりました。

連結自己資本比率（国内基準）は、12.50%（速報値）となりました。なお、当期末を含めた連結自己資本比率の推移は以下のとおりです。

（単位：％）

	16年3月期	17年3月期	18年3月期	18年9月期
連結自己資本比率	10.14	10.34	12.35	12.50%（速報値）

(3) 事業等のリスク

当グループの事業その他に関するリスク要因となりうる主な事項は以下の通りです。なお、以下事項は、決算発表日現在において認識しているものであります。

- ・ 事業戦略に関するリスク
- ・ 不良債権に関するリスク
- ・ 市場リスク
- ・ 金利変動のリスク
- ・ 自己資本比率に関するリスク
- ・ 資金調達に関するリスク
- ・ 格付低下のリスク
- ・ 信託商品の運用成績に関するリスク
- ・ 退職給付債務に関するリスク
- ・ 繰延税金資産に関するリスク
- ・ 情報システムに関するリスク
- ・ 事務に関するリスク
- ・ コンプライアンス・訴訟に関するリスク
- ・ 顧客情報・社内機密情報漏洩に関するリスク
- ・ 規制・制度の変更に関するリスク
- ・ 風評等に関するリスク
- ・ 公的優先株式に関するリスク
- ・ 持株会社であることのリスク

中間連結貸借対照表

三井トラスト・ホールディングス株式会社

(単位：百万円)

科 目	平成 18 年 中間期末(A)	平成 17 年 中間期末(B)	比 較 (A - B)	平成17年度末 (C)	比 較 (A - C)
(資 産 の 部)					
現 金 預 け 金	217,044	422,904	205,859	431,560	214,516
コ ー ル ロ ー ン 及 び 買 入 手 形	258,827	30,524	228,303	164,553	94,274
買 入 現 金 先 払 金	900	20,899	19,999	900	-
債 券 貸 借 取 引 支 払 保 証 金	79,056	168,738	89,682	74,243	4,813
買 入 金 銭 債 権	101,926	114,068	12,141	108,982	7,055
特 定 取 引 資 産	55,373	22,352	33,020	44,883	10,489
金 銭 の 信 託	5,996	12,526	6,530	7,651	1,655
有 価 証 券	3,944,495	3,799,492	145,003	3,835,789	108,705
貸 出 金	7,134,648	7,060,065	74,582	7,292,088	157,439
外 国 為 替	943	878	64	37,598	36,655
そ の 他 資 産	333,054	365,352	32,298	454,267	121,212
有 形 固 定 資 産	207,415	-	207,415	-	207,415
無 形 固 定 資 産	50,705	-	50,705	-	50,705
動 産 不 動 産	-	218,798	218,798	220,351	220,351
繰 延 税 金 資 産	158,058	224,917	66,859	164,313	6,254
繰 延 税 引 当 金	-	9,038	9,038	8,965	8,965
支 払 承 諾 見 込 金	934,982	894,732	40,250	1,023,351	88,369
貸 倒 引 当 金	68,193	70,517	2,324	60,730	7,463
資 産 の 部 合 計	13,415,233	13,294,771	120,461	13,808,769	393,535
(負 債 の 部)					
預 渡 性 預 金	8,211,363	8,880,791	669,428	8,380,196	168,833
コ ー ル マ ネ ー 及 び 売 渡 手 形	291,238	203,607	87,630	394,088	102,850
売 入 現 金 先 払 金	52,416	10,792	41,623	38,307	14,108
債 券 貸 借 取 引 受 入 担 保 金	849,192	602,303	246,889	840,412	8,780
コ マ ー シ ャ ル ・ ペ ー パ ー	1,500	-	1,500	-	1,500
特 定 取 引 負 債	5,364	4,054	1,310	6,945	1,581
借 入 金	207,897	165,403	42,493	165,445	42,451
外 国 為 替 債	5	3	2	47	41
社 債	211,969	209,820	2,149	211,591	378
新 株 予 約 権 付 社 債	106	231	124	120	14
信 託 勘 定 借 入 金	1,152,569	1,120,635	31,934	1,161,278	8,708
そ の 他 負 債	139,130	145,350	6,220	150,615	11,485
賞 与 引 当 金	3,167	3,080	87	3,187	19
退 職 給 付 引 当 金	1,958	1,667	290	1,842	115
補 償 請 求 権 損 失 引 当 金	8,709	-	8,709	9,539	829
日 本 国 際 博 覧 会 出 展 引 当 金	-	110	110	-	-
繰 延 税 金 負 債	24,483	16,058	8,425	29,646	5,162
支 払 承 諾	934,982	894,732	40,250	1,023,351	88,369
負 債 の 部 合 計	12,421,726	12,483,782	62,056	12,843,377	421,650
(純 資 産 の 部)					
資 本 金	261,579	-	261,579	-	261,579
資 本 剰 余 金	126,305	-	126,305	-	126,305
利 益 剰 余 金	332,995	-	332,995	-	332,995
自 己 株 式	1,188	-	1,188	-	1,188
株 主 資 本 合 計	719,691	-	719,691	-	719,691
そ の 他 有 価 証 券 評 価 差 額 金	192,824	-	192,824	-	192,824
繰 延 ヘ ッ ジ 損 益	7,723	-	7,723	-	7,723
土 地 再 評 価 差 額 金	15,527	-	15,527	-	15,527
為 替 換 算 調 整 勘 定	425	-	425	-	425
評 価 ・ 換 算 差 額 等 合 計	169,148	-	169,148	-	169,148
少 数 株 主 持 分	104,667	-	104,667	-	104,667
純 資 産 の 部 合 計	993,506	-	993,506	-	993,506
負 債 及 び 純 資 産 の 部 合 計	13,415,233	-	13,415,233	-	13,415,233
(少 数 株 主 持 分)					
少 数 株 主 持 分	-	106,309	106,309	106,541	106,541
(資 本 の 部)					
資 本 金	-	261,579	261,579	261,579	261,579
資 本 剰 余 金	-	126,247	126,247	126,297	126,297
利 益 剰 余 金	-	213,565	213,565	274,583	274,583
土 地 再 評 価 差 額 金	-	15,523	15,523	15,527	15,527
株 式 等 評 価 差 額 金	-	120,415	120,415	213,547	213,547
為 替 換 算 調 整 勘 定	-	666	666	539	539
自 己 株 式	-	938	938	1,090	1,090
資 本 の 部 合 計	-	704,679	704,679	858,850	858,850
負 債 ・ 少 数 株 主 持 分 及 び 資 本 の 部 合 計	-	13,294,771	13,294,771	13,808,769	13,808,769

- 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. 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」という。）の取引については、取引の約定時点を基準とし、中間連結貸借対照表上「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中間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中間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。
3. 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（定額法）、持分法非適用の非連結子会社・子法人等株式については移動平均法による原価法、その他有価証券のうち時価のある株式及び投資信託受益証券については中間連結決算日前1カ月の市場価格の平均等、それ以外については中間連結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）、時価のないもの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。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。
4. 金銭の信託において信託財産を構成している有価証券の評価は、上記3.と同じ方法により行っております。
5. 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。
6. 連結される信託銀行子会社の有形固定資産の減価償却は、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、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。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。
- 当社並びにその他の連結される子会社及び子法人等の有形固定資産については、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。
7. 無形固定資産の減価償却は、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、当社並びに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）に基づいて償却しております。
8. 社債発行費は資産として計上し、「繰延資産の会計処理に関する当面の取扱い」（実務対応報告第19号平成18年8月11日）の経過措置に基づき従前の会計処理（3年間の均等償却）を適用しております。
9. 連結される信託銀行子会社の外貨建資産・負債は、主として中間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。
- その他の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、それぞれの中間決算日等の為替相場により換算しております。
10. 主要な国内の連結される子会社及び子法人等の貸倒引当金は、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。）に係る債権については、以下のなお書きに記載されている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（以下、「破綻懸念先」という。）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。

破綻懸念先及び下記23.の貸出条件緩和債権等を有する債務者で与信額が一定額以上の大口債務者のうち、債権の元本の回収及び利息の受取りに係るキャッシュ・フローを合理的に見積もることができる債権については、当該キャッシュ・フローを貸出条件緩和実施前の約定利子率で割引いた金額と債権の帳簿価額との差額を貸倒引当金とする方法（キャッシュ・フロー見積法）により引き当てております。

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内部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115,738百万円であります。

その他の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られた額を、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。

11. 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、当中間連結会計期間に帰属する額を計上しております。
12. 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、当中間連結会計期間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。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	その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	各連結会計年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（8年～9年）による定額法により按分した額をそれぞれ発生の翌連結会計年度から損益処理
13. 補償請求権損失引当金は、土地信託事業の状況により、将来、受託者として債務の立替等の負担が生じ、それにより取得する補償請求権が毀損する可能性が高い場合に、当該損失を合理的に見積り必要と認められる額を計上しております。
14. 当社並びに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. 連結される信託銀行子会社の金融資産・負債から生じる金利リスクに対するヘッジ会計の方法は、「銀行業における金融商品会計基準適用に関する会計上及び監査上の取扱い」（日本公認会計士協会業種別監査委員会報告第24号）に規定する繰延ヘッジによっております。ヘッジ有効性評価の方法については、相場変動を相殺するヘッジについて、ヘッジ対象となる預金・貸出金等

とヘッジ手段である金利スワップ取引等を一定の（残存）期間毎にグルーピングのうえ特定し評価しております。

16. 連結される信託銀行子会社の外貨建金融資産・負債から生じる為替変動リスクに対するヘッジ会計の方法は、「銀行業における外貨建取引等の会計処理に関する会計上及び監査上の取扱い」（日本公認会計士協会業種別監査委員会報告第25号）に規定する繰延ヘッジによっております。ヘッジ有効性評価の方法については、外貨建金銭債権債務等の為替変動リスクを減殺する目的で行う通貨スワップ取引及び為替スワップ取引等をヘッジ手段とし、ヘッジ対象である外貨建金銭債権債務等に見合うヘッジ手段の外貨ポジション相当額が存在することを確認することによりヘッジの有効性を評価しております。

また、外貨建有価証券（債券以外）の為替変動リスクをヘッジするため、事前にヘッジ対象となる外貨建有価証券の銘柄を特定し、当該外貨建有価証券について外貨ベースで取得原価以上の直先負債が存在していること等を条件に包括ヘッジとして時価ヘッジを適用しております。

なお、一部の資産・負債について、繰延ヘッジ、時価ヘッジ、あるいは金利スワップの特例処理を行っております。

その他の連結される子会社及び子法人等のヘッジ会計の方法は、時価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。

17. 当社並びに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、有形固定資産に係る控除対象外消費税等は当期の費用に計上しております。

18. 関係会社の株式及び出資総額（子会社の株式を除く） 91,536 百万円

19. 有形固定資産の減価償却累計額 219,683 百万円

20. 有形固定資産の圧縮記帳額 7,283 百万円

21. 貸出金のうち、破綻先債権額は11,965百万円、延滞債権額は48,352百万円であります。

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カ月以上延滞債権額は 209百万円であります。

なお、3カ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カ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72,340百万円であります。

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カ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カ月以上延滞債権額及び貸出条件緩和債権額の合計額は132,868百万円であります。

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. 手形割引は、業種別監査委員会報告第24号に基づき金融取引として処理しております。これにより受け入れた商業手形は、売却又は（再）担保という方法で自由に処分できる権利を有しておりますが、その額面金額は8,222百万円であります。

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	1,250,382百万円
貸出金	215,328百万円
その他資産	137百万円

担保資産に対応する債務

預金	4,523百万円
コールマネー及び売渡手形	110,000百万円
売現先勘定	52,416百万円
債券貸借取引受入担保金	849,192百万円
借入金	55,246百万円

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 285,909百万円、その他の資産66百万円を差し入れております。

また、その他資産のうち先物取引差入証拠金は28百万円、保証金敷金は9,241百万円であります。

27. 中央三井信託銀行株式会社が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「土地再評価差額金」として純資産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。

28. 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 130,000百万円が含まれております。

29. 社債には、永久劣後特約付社債121,315百万円及び劣後特約付社債90,654百万円であります。

30. 新株予約権付社債は全額、劣後特約付転換社債であります。

31. 1株当たりの純資産額 540円 68銭

「1株当たり当期純利益に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第4号平成14年9月25日）が平成18年1月31日付で改正され、会社法施行日以後終了する中間連結会計期間から適用されることになったことに伴い、当中間連結会計期間から同適用指針を適用し、1株当たりの純資産額は「繰延ヘッジ損益」を含めて算出しております。これにより、従来の方法に比べ1株当たりの純資産額は8円54銭減少しております。

32. 有価証券の時価及び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、並びに「買入金銭債権」中のその他の買入金銭債権が含まれております。33.についても同様であります。

満期保有目的の債券で時価のあるもの

	中間連結貸借対照表 計上額（百万円）	時価 （百万円）	差額 （百万円）
国債	394,085	394,025	60
地方債	-	-	-
社債	11,200	11,200	-
その他	75,846	73,776	2,069
合計	481,131	479,001	2,130

その他有価証券で時価のあるもの

	取得原価 （百万円）	中間連結貸借対照表 計上額（百万円）	評価差額 （百万円）
株式	490,100	835,311	345,210
債券	1,747,885	1,688,916	58,969
国債	1,458,796	1,400,719	58,077
地方債	3,288	3,264	23
社債	285,801	284,932	868
その他	800,757	788,924	11,832
合計	3,038,744	3,313,152	274,407

なお、上記の評価差額に組合等の構成資産であるその他有価証券に係る評価差額12,635百万円を加えた287,043百万円から繰延税金負債95,062百万円を差し引いた額191,980百万円のうち少数株主持分相当額72百万円を控除した額に、持分法適用会社が所有するその他有価証券に係る評価差額金のうち親会社持分相当額 10百万円を加算した額191,897百万円が、「その他有価証券評価差額金」に含まれております。

その他有価証券で時価のあるもののうち、時価が取得原価に比べて著しく下落したものについては、原則として時価が取得原価まで回復する見込みがないものとみなして、当該時価をもって中間連結貸借対照表計上額とし、評価差額を当中間連結会計期間の損失として処理（以下、「減損処理」という。）しております。

当中間連結会計期間において、その他有価証券で時価のある株式等について4,807百万円の減損処理を行っております。

「時価が著しく下落した」と判断するための基準は、資産の自己査定基準において有価証券の発行会社の区分ごとに次のとおり定めております。

破綻先、実質破綻先、破綻懸念先	時価が取得原価に比べて下落
要注意先	時価が取得原価に比べて30%以上下落
正常先	時価が取得原価に比べて30%以上下落

上記自己査定基準に該当する正常先のうち、時価が取得原価に比べて30%以上50%未満下落した銘柄については、個別に時価の回復可能性を判定し、取得原価まで回復する可能性があると思われる場合を除き、減損処理を実施しております。それ以外の場合は全て、取得原価まで回復する見込みがないと判断し、減損処理を実施しております。

なお、破綻先とは破産、特別清算等、法的に経営破綻の事実が発生している発行会社、実質破綻先とはそれと同等の状況にある発行会社、破綻懸念先とは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発行会社、要注意先とは今後の管理に注意を要す

る発行会社、正常先とは、上記破綻先、実質破綻先、破綻懸念先、要注意先以外の発行会社であります。

33. 時価評価されていない有価証券のうち、主なものの内容と中間連結貸借対照表計上額は、次のとおりであります。

	金額（百万円）
その他有価証券	
非上場株式	100,087
非上場外国証券	5,724
出資証券	28,775

34. 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。

	取得原価 （百万円）	中間連結貸借対照表 計上額（百万円）	評価差額 （百万円）
その他の金銭の 信託	3,815	5,996	2,180

なお、上記の評価差額から繰延税金負債887百万円を差し引いた額1,293百万円のうち少数株主持分相当額147百万円を控除した額1,145百万円が、「その他有価証券評価差額金」に含まれております。

35. 現先取引並びに現金担保付債券貸借取引等により受入れている有価証券で当中間連結会計期間末に所有しているものが74,033百万円あります。これらは、売却又は（再）担保という方法で自由に処分できる権利を有する有価証券ですが、当中間連結会計期間末においては当該処分をせずにすべて所有しております。

36. 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、2,257,644百万円あります。このうち契約残存期間が1年以内のものが2,125,067百万円あります。

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並びに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、債権の保全及びその他相当の事由があるときは、当社並びに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き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。

37. 従来、その他有価証券に区分されるクレジット・リンク債については、組込デリバティブを組込対象である現物の金融資産とは区分して時価評価し、評価差額を損益に計上しておりましたが、「その他の複合金融商品（払込資本を増加させる可能性のある部分を含まない複合金融商品）に関する会計処理」（企業会計基準適用指針第12号平成18年3月30日）が公表されたことに伴い、当中間連結会計期間から同適用指針を適用し、組込デリバティブの経済的性格及びリスクが組み込まれた現物の金融資産の経済的性格及びリスクと緊密な関係にあり、組込デリバティブのリスクが現物の金融資産の当初元本に及ぶ可能性が低いといえるものについては、現物の金融資産と組込デリバティブ部分を区分せず一体として時価評価し、評価差額（税効果額控除後）を純資産の部に計上しております。なお、この変更に伴う影響は軽微であります。

38. 「貸借対照表の純資産の部の表示に関する会計基準」（企業会計基準第5号平成17年12月9日）

および「貸借対照表の純資産の部の表示に関する会計基準等の適用指針」（企業会計基準適用指針第8号平成17年12月9日）が会社法施行日以後終了する中間連結会計期間から適用されることになったこと等から、「銀行法施行規則」（昭和57年大蔵省令第10号）が「無尽業法施行細則等の一部を改正する内閣府令」（内閣府令第60号平成18年4月28日）により改正され、平成18年4月1日以後開始する事業年度から適用されることになったことに伴い、当中間連結会計期間から以下のとおり表示を変更しております。

(1)「資本の部」は「純資産の部」とし、株主資本、評価・換算差額等及び少数株主持分に区分のうえ表示しております。

なお、当中間連結会計期間末における従来の「資本の部」に相当する金額は896,562百万円であります。

(2)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したヘッジ手段に係る損益又は評価差額は、税効果額を控除のうえ評価・換算差額等の「繰延ヘッジ損益」として相殺表示しております。

(3)「株式等評価差額金」は、「その他有価証券評価差額金」として表示しております。

(4)負債の部の次に表示していた「少数株主持分」は、純資産の部に表示しております。

(5)「動産不動産」は、「有形固定資産」「無形固定資産」または「その他資産」に区分して表示しております。

(6)「その他資産」に含めて表示していたソフトウェアは、「無形固定資産」に含めて表示しております。

(7)資産の部に独立掲記していた「連結調整勘定」は、「無形固定資産」中「のれん」に含めて表示しております。これに伴い、連結調整勘定償却は、従来、「経常費用」中「その他経常費用」で処理しておりましたが、当中間連結会計期間からは無形固定資産償却として「経常費用」中「営業経費」に含めております。

39. 「投資事業組合に対する支配力基準及び影響力基準の適用に関する実務上の取扱い」（実務対応報告第20号平成18年9月8日）が公表日以後終了する中間連結会計期間に係る中間連結財務諸表から適用されることになったことに伴い、当中間連結会計期間から同実務対応報告を適用しております。これによる中間連結貸借対照表等に与える影響は軽微であります。

40. 連結される信託銀行子会社の受託する元本補てん契約のある信託の元本金額は、金銭信託1,232,097百万円、貸付信託1,178,523百万円であります。

中間連結損益計算書

三井トラスト・ホールディングス株式会社

(単位：百万円)

科 目	平成 18 年 中間期(A)	平成 17 年 中間期(B)	比 較 (A - B)	平成17年度 (要 約)
経 常 収 益	214,259	223,757	9,497	481,036
信 託 報 酬	37,228	37,540	312	72,049
資 金 運 用 収 益	67,018	72,914	5,896	165,450
(うち貸出金利息)	(37,083)	(43,458)	(6,375)	(84,237)
(うち有価証券利息配当金)	(27,102)	(25,003)	(2,098)	(72,920)
役 務 取 引 等 収 益	62,694	58,130	4,563	122,711
特 定 取 引 収 益	2,516	2,336	180	4,503
そ の 他 業 務 収 益	2,728	10,832	8,104	22,577
そ の 他 経 常 収 益	42,074	42,002	71	93,743
経 常 費 用	145,760	156,076	10,315	342,675
資 金 調 達 費 用	25,889	23,010	2,878	46,622
(うち預金利息)	(10,180)	(8,715)	(1,465)	(16,992)
役 務 取 引 等 費 用	8,199	7,472	726	15,691
特 定 取 引 費 用	89	-	89	139
そ の 他 業 務 費 用	3,307	10,916	7,608	19,579
営 業 経 費	66,911	63,685	3,225	129,007
そ の 他 経 常 費 用	41,363	50,991	9,627	131,635
経 常 利 益	68,498	67,681	817	138,361
特 別 利 益	18,806	1,317	17,489	3,391
特 別 損 失	206	1,078	871	1,831
税金等調整前中間(当期)純利益	87,099	67,920	19,178	139,921
法人税、住民税及び事業税	6,434	5,453	981	12,201
法人税等調整額	10,563	692	9,871	1,901
少数株主利益	3,120	3,103	16	6,132
中 間 (当 期) 純 利 益	66,981	58,671	8,310	119,684

- 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. 1株当たり中間純利益金額 78円 62銭
3. 潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額 38円 46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中間連結損益計算書上「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、当中間連結会計期間中の受払利息等に、有価証券、金銭債権等については前連結会計年度末と当中間連結会計期間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中間連結会計期間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. 「その他経常費用」には、貸出金償却1,426百万円、貸倒引当金繰入額10,997百万円及び株式等償却5,425百万円を含んでおります。
6. 特別利益には、退職給付信託を一部返還したことによる返還益15,814百万円を含んでおります。

中間連結株主資本等変動計算書

当中間連結会計期間（自 平成18年4月1日 至平成18年9月30日）

（単位：百万円）

	株 主 資 本				
	資 本 金	資 本 剰 余 金	利 益 剰 余 金	自 己 株 式	株 主 資 本 合 計
直前連結会計年度末残高	261,579	126,297	274,583	1,090	661,369
中間連結会計期間の変動額					
剰余金の配当	-	-	8,569	-	8,569
中間純利益	-	-	66,981	-	66,981
自己株式の取得	-	-	-	111	111
自己株式の処分	-	8	-	12	20
株主資本以外の項目の 中間連結会計期間の変動額（純 額）	-	-	-	-	-
中間連結会計期間の変動額合計	-	8	58,411	98	58,321
中間連結会計期間末残高	261,579	126,305	332,995	1,188	719,691

（単位：百万円）

	評 価 ・ 換 算 差 額 等					少 数 株 主 持 分	純 資 産 合 計
	そ の 他 有 価 証 券 評 価 差 額 金	繰 延 ヘ ッ ジ 損 益	土 地 再 評 価 差 額 金	為 替 換 算 調 整 勘 定	評 価 ・ 換 算 差 額 等 合 計		
直前連結会計年度末残高	213,547	-	15,527	539	197,480	106,541	965,391
中間連結会計期間の変動額							
剰余金の配当	-	-	-	-	-	-	8,569
中間純利益	-	-	-	-	-	-	66,981
自己株式の取得	-	-	-	-	-	-	111
自己株式の処分	-	-	-	-	-	-	20
株主資本以外の項目の 中間連結会計期間の変動額（純 額）	20,722	7,723	-	113	28,332	1,874	30,206
中間連結会計期間の変動額合計	20,722	7,723	-	113	28,332	1,874	28,115
中間連結会計期間末残高	192,824	7,723	15,527	425	169,148	104,667	993,506

- 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. 発行済株式の種類及び総数並びに自己株式の種類および株式数は、次のとおりであります。

	直前連結会計 年度末株式数	当中間連結会計 期間増加株式数	当中間連結会計 期間減少株式数	当中間連結会計 期間末株式数	摘要
発行済株式					
普通株式	824,345,213株	80,930,703株	-株	905,275,916株	注1
第一種優先株式	20,000,000株	-株	20,000,000株	-株	注1
第二種優先株式	93,750,000株	-株	-株	93,750,000株	
第三種優先株式	156,406,250株	-株	-株	156,406,250株	
合計	1,094,501,463株	80,930,703株	20,000,000株	1,155,432,166株	
自己株式					
普通株式	1,574,204株	77,330株	17,662株	1,633,872株	注2

- (注) 1. 第一種優先株式の普通株式への転換による増減であります。
 2. 単位未満株式の買取りおよび処分による増減であります。

3. 当社の配当については、次のとおりであります。

当中間連結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 の金額	基準日	効力発生日
18年6月29日 定時株主総会	普通株式	3,291百万円	4.00円	平成18年3月31日	平成18年6月29日
	第一種優先株式	800百万円	40.00円	平成18年3月31日	平成18年6月29日
	第二種優先株式	1,350百万円	14.40円	平成18年3月31日	平成18年6月29日
	第三種優先株式	3,128百万円	20.00円	平成18年3月31日	平成18年6月29日

4. 「株主資本等変動計算書に関する会計基準」(企業会計基準第6号平成17年12月27日)および「株主資本等変動計算書に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第9号平成17年12月27日)が会社法施行日以降終了する中間連結会計期間から適用されることになったことに伴い、当中間連結会計期間から同会計基準および適用指針を適用し、従来の中間連結剰余金計算書に替えて中間連結株主資本等変動計算書を作成しております。

中間連結キャッシュ・フロー計算書

三井トラスト・ホールディングス株式会社
(単位：百万円)

	平成 18 年 中間期 (A)	平成 17 年 中間期 (B)	比 較 (A - B)	平成17年度
営業活動によるキャッシュ・フロー				
税金等調整前中間(当期)純利益	87,099	67,920	19,178	139,921
減価償却費	20,989	22,955	1,965	46,023
減損損失	-	519	519	540
のれん償却額	72	-	72	-
連結調整勘定償却額	-	72	72	145
持分法による投資損益()	578	276	301	905
貸倒引当金の増加額	7,463	4,317	3,146	5,470
賞与引当金の増加額	19	27	46	134
退職給付引当金の増加額	115	100	14	275
補償請求権損失引当金の増加額	829	-	829	9,539
日本国際博覧会出展引当金の増加額	-	20	20	89
資金運用収益	67,018	72,914	5,896	165,450
資金調達費用	25,889	23,010	2,878	46,622
有価証券関係損益()	4,521	3,607	913	20,937
金銭の信託の運用損益()	170	74	96	766
為替差損益()	2,098	23,866	25,965	41,403
固定資産処分損益()	203	-	203	-
動産不動産処分損益()	-	500	500	1,079
特定取引資産の純増()減	10,489	6,896	17,386	15,633
特定取引負債の純増減()	1,581	4,172	2,591	1,281
貸出金の純増()減	157,439	84,512	72,927	147,509
預金の純増減()	168,833	151,213	320,046	349,381
譲渡性預金の純増減()	101,090	17,130	118,220	218,750
借入金(劣後特約付借入金を除く)の純増減()	49,451	4,330	45,120	4,372
預け金(日銀預け金を除く)の純増()減	14,383	39,371	53,755	18,308
コールローン等の純増()減	87,131	36,341	50,790	145,493
債券貸借取引支払保証金の純増()減	4,813	114,988	110,175	20,493
コールマネー等の純増減()	88,741	160,830	72,089	57,165
コマーシャル・ペーパーの純増減()	1,500	-	1,500	-
債券貸借取引受入担保金の純増減()	8,780	273,522	282,303	35,414
外国為替(資産)の純増()減	36,655	1,002	35,652	35,717
外国為替(負債)の純増減()	41	33	8	11
信託勘定借の純増減()	8,708	118,490	109,781	77,847
資金運用による収入	70,621	75,057	4,435	173,103
資金調達による支出	22,311	24,371	2,059	48,563
その他	1,770	14,713	12,943	32,360
小計	114,653	349,245	234,591	465,344
法人税等の支払額	5,250	1,340	3,910	7,104
営業活動によるキャッシュ・フロー	119,904	350,585	230,681	472,449
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	1,300,659	1,414,013	113,353	3,097,698
有価証券の売却による収入	149,515	729,278	579,763	1,293,925
有価証券の償還による収入	1,090,260	1,021,554	68,706	2,230,062
金銭の信託の増加による支出	-	239	239	-
金銭の信託の減少による収入	1,965	-	1,965	5,231
有形固定資産の取得による支出	18,048	-	18,048	-
動産不動産の取得による支出	-	16,206	16,206	36,607
有形固定資産の売却による収入	2,708	-	2,708	-
動産不動産の売却による収入	-	1,528	1,528	3,931
無形固定資産の取得による支出	7,135	-	7,135	-
無形固定資産の売却による収入	215	-	215	-
連結子会社株式の取得による支出	8,754	-	8,754	-
投資活動によるキャッシュ・フロー	89,934	321,901	411,835	398,845
財務活動によるキャッシュ・フロー				
劣後特約付借入金の返済による支出	7,000	13,000	6,000	13,000
劣後特約付社債の発行による収入	-	5,000	5,000	5,000
劣後特約付社債の償還による支出	-	-	-	2,000
配当金支払額	8,569	7,335	1,234	7,335
少数株主への配当金支払額	3,499	3,267	232	5,279
自己株式の取得による支出	111	186	75	404
自己株式の売却による収入	6	1	4	6
財務活動によるキャッシュ・フロー	19,173	18,787	386	23,012
現金及び現金同等物に係る換算差額	112	55	167	66
現金及び現金同等物の増加額	228,900	47,527	181,372	96,551
現金及び現金同等物の期首残高	351,462	448,014	96,551	448,014
現金及び現金同等物の中間期末(期末)残高	122,562	400,486	277,924	351,462

- 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. 中間連結キャッシュ・フロー計算書における資金の範囲は、中間連結貸借対照表上の「現金預け金」（連結される信託銀行子会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中間期末残高と中間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	217,044百万円
<u>連結される信託銀行子会社の預け金（日本銀行への預け金を除く）</u>	<u>94,481百万円</u>
現金及び現金同等物	<u>122,562百万円</u>

4. 「銀行法施行規則」（昭和57年大蔵省令第10号）が「無尽業法施行細則等の一部を改正する内閣府令」（内閣府令第60号平成18年4月28日）により改正され、平成18年4月1日以後開始する連結会計年度から適用されることになったことに伴い、当中間連結会計期間から以下のとおり中間連結キャッシュ・フロー計算書の表示を変更しております。

（1）「連結調整勘定償却額」は「のれん償却額」に含めて表示しております。

（2）「動産不動産処分損益（ ）」は、中間連結貸借対照表の「動産不動産」が「有形固定資産」、「無形固定資産」等に区分されたことに伴い、「固定資産処分損益（ ）」等として表示しております。

「動産不動産の取得による支出」は「有形固定資産の取得による支出」等として、「動産不動産の売却による収入」は、「有形固定資産の売却による収入」等として表示しております。また、従来営業活動によるキャッシュ・フローの「その他」に含まれていた無形固定資産の取得および売却については、投資活動によるキャッシュ・フローの「無形固定資産の取得による支出」、「無形固定資産の売却による収入」として表示しております。

(合 算) 信 託 財 産 残 高 表
(平成18年9月30日現在)

「金融機関の信託業務の兼営等に関する法律」に基づき、信託業務を営む中央三井信託銀行株式会社及び三井アセット信託銀行株式会社の信託財産額を単純合算しております。

(単位：百万円)

資 産	金 額	負 債	金 額
貸 出 金	975,965	金 銭 信 託	18,151,380
有 価 証 券	7,411,460	年 金 信 託	6,336,196
信 託 受 益 権	29,856,641	財 産 形 成 給 付 信 託	16,477
受 託 有 価 証 券	261	貸 付 信 託	948,817
金 銭 債 権	1,789,957	投 資 信 託	10,000,031
動 産 不 動 産	4,139,192	金 銭 信 託 以 外 の 金 銭 の 信 託	445,785
地 上 権	1,752	有 価 証 券 の 信 託	1,002,920
不 動 産 の 賃 借 権	4,747	金 銭 債 権 の 信 託	1,827,790
そ の 他 債 権	83,521	動 産 の 信 託	90
銀 行 勘 定 貸	1,152,569	土 地 及 び そ の 定 着 物 の 信 託	80,666
現 金 預 け 金	288,836	包 括 信 託	6,894,748
合 計	45,704,906	合 計	45,704,906

- (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. 信託受益権には、資産管理を目的として再信託を行っている金額29,833,855百万円が含まれております。
 3. 共同信託他社管理財産 3,900,235 百万円
 4. 元本補てん契約のある信託の貸出金946,118百万円のうち破綻先債権額は325百万円、延滞債権額は11,301百万円、3ヵ月以上延滞債権額は584百万円、貸出条件緩和債権額は14,635百万円であります。また、これらの債権額の合計額は26,846百万円であります。

(付) 元本補てん契約のある信託(信託財産の運用のため再信託された信託を含む。)の内訳は次のとおりであります。(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 銭 信 託

(単位：百万円)

資 産	金 額	負 債	金 額
貸 出 金	344,497	元 本	1,232,097
有 価 証 券	30,310	債 権 償 却 準 備 金	49
そ の 他	857,177	そ の 他	160
計	1,231,986	計	1,231,986

貸 付 信 託

(単位：百万円)

資 産	金 額	負 債	金 額
貸 出 金	601,620	元 本	1,178,523
有 価 証 券	20,104	特 別 留 保 金	6,395
そ の 他	563,786	そ の 他	591
計	1,185,511	計	1,185,511

中間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 27社

主要な会社名

中央三井信託銀行株式会社

三井アセット信託銀行株式会社

MTH Preferred Capital 1 (Cayman) Limited

MTH Preferred Capital 2 (Cayman) Limited

MTH Preferred Capital 3 (Cayman) Limited

MTH Preferred Capital 4 (Cayman) Limited

(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、中間純損益（持分に見合う額）及び利益剰余金（持分に見合う額）等からみて、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 3社

主要な会社名

日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社

日本トラスティ情報システム株式会社

(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、中間純損益（持分に見合う額）及び利益剰余金（持分に見合う額）等からみて、持分法の対象から除いても中間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中間決算日等に関する事項

(1) 連結される子会社及び子法人等の中間決算日は次のとおりであります。

1月24日 4社

6月末日 6社

9月末日 17社

(2) 1月24日を中間決算日とする連結される子会社及び子法人等は、9月末日現在で実施した仮決算に基づく財務諸表により、またその他の連結される子会社及び子法人等は、それぞれの中間決算日の財務諸表により連結しております。

中間連結決算日と上記の中間決算日等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。

セグメント情報

1. 事業の種類別セグメント情報

当中間連結会計期間（自平成18年4月1日 至平成18年9月30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
経常収益					
(1)外部顧客に対する経常収益	183,817	30,442	214,259	-	214,259
(2)セグメント間の内部経常収益	8,728	25,732	34,460	(34,460)	-
計	192,545	56,175	248,720	(34,460)	214,259
経常費用	123,531	32,102	155,633	(9,873)	145,760
経常利益	69,013	24,072	93,086	(24,587)	68,498

前中間連結会計期間（自平成17年4月1日 至平成17年9月30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
経常収益					
(1)外部顧客に対する経常収益	196,757	27,000	223,757	-	223,757
(2)セグメント間の内部経常収益	7,371	25,676	33,048	(33,048)	-
計	204,129	52,676	256,805	(33,048)	223,757
経常費用	136,977	26,687	163,665	(7,588)	156,076
経常利益	67,151	25,989	93,140	(25,459)	67,681

前連結会計年度（自平成17年4月1日 至平成18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
経常収益					
(1)外部顧客に対する経常収益	424,196	56,840	481,036	-	481,036
(2)セグメント間の内部経常収益	14,554	27,937	42,492	(42,492)	-
計	438,750	84,777	523,528	(42,492)	481,036
経常費用	301,857	57,422	359,279	(16,604)	342,675
経常利益	136,893	27,355	164,249	(25,887)	138,361

- (注) 1. 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。
 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。

2. 所在地別セグメント情報

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	国際業務経常収益の連結 経常収益に占める割合
当中間連結会計期間 自 平成18年 4月 1日 至 平成18年 9月30日	16,633	214,259	7.7%
前中間連結会計期間 自 平成17年 4月 1日 至 平成17年 9月30日	19,967	223,757	8.9%
前連結会計年度 自 平成17年 4月 1日 至 平成18年 3月31日	46,056	481,036	9.5%

(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。

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。

有価証券の時価等

三井トラスト・ホールディングス株式会社

【当中間連結会計期間末】

(注) 中間連結貸借対照表の「有価証券」のほか、「買入金銭債権」中のその他の買入金銭債権が含まれております。

1. 有価証券

(1) 満期保有目的の債券で時価のあるもの

(単位：百万円)

種類	期別	当中間連結会計期間末 (平成18年9月30日現在)		
		中間連結貸借対照表計上額	時価	差額
国債		394,085	394,025	60
地方債		-	-	-
社債		11,200	11,200	-
その他		75,846	73,776	2,069
合計		481,131	479,001	2,130

(注) 時価は、当中間連結会計期間末日における市場価格等に基づいております。

(2) その他有価証券で時価のあるもの

(単位：百万円)

種類	期別	当中間連結会計期間末 (平成18年9月30日現在)		
		取得原価	中間連結貸借対照表計上額	評価差額
株式		490,100	835,311	345,210
債券	国債	1,747,885	1,688,916	58,969
	地方債	1,458,796	1,400,719	58,077
	社債	3,288	3,264	23
	その他	285,801	284,932	868
合計		3,038,744	3,313,152	274,407

(注) 中間連結貸借対照表計上額は、株式ならびに投資信託については当中間連結会計期間末前1ヵ月の市場価格の平均等に基づいて算定された額により、また、それ以外については、当中間連結会計期間末日における市場価格等に基づく時価により、それぞれ計上したものであります。

(3) 時価評価されていない主な有価証券の内容及び中間連結貸借対照表計上額

(単位：百万円)

	当中間連結会計期間末 (平成18年9月30日現在)
その他有価証券	
非上場株式	100,087
非上場外国証券	5,724
出資証券	28,775

2. 金銭の信託

(1) 満期保有目的の金銭の信託

該当ありません。

(2) その他の金銭の信託 (運用目的及び満期保有目的以外)

(単位：百万円)

種類	期別	当中間連結会計期間末 (平成18年9月30日現在)		
		取得原価	中間連結貸借対照表計上額	評価差額
その他の金銭の信託		3,815	5,996	2,180

(注) 中間連結貸借対照表計上額は、当中間連結会計期間末日における市場価格等に基づく時価により計上したものであります。

3. その他有価証券評価差額金

中間連結貸借対照表に計上されているその他有価証券評価差額金の内訳は、次のとおりであります。

(単位：百万円)

	当中間連結会計期間末 (平成18年9月30日現在)
評価差額	289,005
その他有価証券	286,824
その他の金銭の信託	2,180
() 繰延税金負債	95,950
その他有価証券評価差額金 (持分相当額調整前)	193,055
() 少数株主持分相当額	220
(+) 持分法適用会社が所有するその他有価証券に係る評価差額金のうち親会社持分相当額	10
その他有価証券評価差額金	192,824

(注) 1 時価がないその他有価証券に係る為替換算差額については、「評価差額」の内訳「その他有価証券」に含めて記載しております。

2 評価差額には、組合等の構成資産であるその他有価証券に係る評価差額12,635百万円が含まれております。

有価証券の時価等

三井トラスト・ホールディングス株式会社

【前中間連結会計期間末及び前連結会計年度末】

(注) 中間連結貸借対照表の「有価証券」のほか、「買入金銭債権」中のその他の買入金銭債権が含まれております。

1. 有価証券

(1) 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	前中間連結会計期間末 (平成17年9月30日現在)					前連結会計年度末 (平成18年3月31日現在)				
	中間連結貸借 対照表計上額	時 価	差 額	うち益		連 結 貸 借 対照表計上額	時 価	差 額	うち益	
				うち益	うち損				うち益	うち損
国 債	125	126	1	1	-	196,457	194,584	1,872	-	1,872
地 方 債	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
社 債	11,200	11,200	-	-	-	11,200	11,200	-	-	-
そ の 他	79,512	79,255	257	295	552	79,069	76,619	2,449	15	2,465
合 計	90,838	90,582	255	296	552	286,726	282,404	4,322	15	4,338

(注) 1. 時価は、前中間連結会計期間末日及び前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。

2. 「うち益」「うち損」はそれぞれ「差額」の内訳であります。

(2) その他有価証券で時価のあるもの

(単位: 百万円)

期別 種類	前中間連結会計期間末 (平成17年9月30日現在)					前連結会計年度末 (平成18年3月31日現在)				
	取得原価	中間連結貸借 対照表計上額	評 価 差 額	うち益		取得原価	連 結 貸 借 対照表計上額	評 価 差 額	うち益	
				うち益	うち損				うち益	うち損
株 式	472,274	670,162	197,887	219,231	21,343	464,284	839,860	375,575	389,042	13,467
債 券	1,792,587	1,745,934	46,653	1,264	47,918	1,849,082	1,778,463	70,618	364	70,982
国 債	1,578,104	1,530,543	47,560	20	47,581	1,580,666	1,511,951	68,714	12	68,726
地方債	1,854	1,863	8	18	10	3,309	3,275	34	7	41
社 債	212,628	213,527	898	1,225	326	265,105	263,235	1,869	344	2,214
そ の 他	1,084,520	1,079,262	5,257	7,543	12,801	808,099	815,256	7,156	26,138	18,981
合 計	3,349,382	3,495,359	145,976	228,039	82,062	3,121,465	3,433,579	312,113	415,545	103,431

(注) 1. (中間)連結貸借対照表計上額は、株式ならびに投資信託については前中間連結会計期間末及び前連結会計年度末前1ヵ月の市場価格の平均に基づいて算定された額により、また、それ以外については、前中間連結会計期間末日及び前連結会計年度末日における市場価格等に基づく時価により、それぞれ計上したものであります。

2. 「うち益」「うち損」はそれぞれ「評価差額」の内訳であります。

(3) 時価のない有価証券の主な内容及び(中間)連結貸借対照表計上額

(単位: 百万円)

	前中間連結会計期間末 (平成17年9月30日現在)	前連結会計年度末 (平成18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)	123,139	108,373
非上場外国証券	56,531	6,325
出資証券	99,786	63,750

2. 金銭の信託

(1) 満期保有目的の金銭の信託

前中間連結会計期間末 (平成15年9月30日) 及び前連結会計年度末 (平成16年3月31日)

該当ありません。

(2) その他の金銭の信託 (運用目的及び満期保有目的以外)

(単位: 百万円)

期別 種類	前中間連結会計期間末 (平成17年9月30日現在)					前連結会計年度末 (平成18年3月31日現在)				
	取得原価	中間連結貸借 対照表計上額	評 価 差 額	うち益		取得原価	連 結 貸 借 対照表計上額	評 価 差 額	うち益	
				うち益	うち損				うち益	うち損
その他の金銭の信託	3,806	5,943	2,137	2,137	-	3,811	5,852	2,041	2,041	-

(注) 1. (中間)連結貸借対照表計上額は、前中間連結会計期間末日及び前連結会計年度末日における市場価格等に基づく時価により計上したものであります。

2. 「うち益」「うち損」はそれぞれ「評価差額」の内訳であります。

3. 株式等評価差額金

(中間)連結貸借対照表に計上されている株式等評価差額金の内訳は、次のとおりであります。

(単位: 百万円)

	前中間連結会計期間末 (平成17年9月30日現在)	前連結会計年度末 (平成18年3月31日現在)
評価差額	147,854	313,929
その他有価証券	145,716	311,888
その他の金銭の信託	2,137	2,041
() 繰延税金負債	27,203	100,136
株式等評価差額金 (持分相当額調整前)	120,650	213,793
() 少数株主持分相当額	231	236
(+) 持分法適用会社が所有するその他有価証券に係る評価差額金のうち親会社持分相当額	3	9
株式等評価差額金	120,415	213,547

(注) 時価がないその他有価証券に係る為替換算差額については、「評価差額」の内訳「その他有価証券」に含めて記載しております。

デリバティブ取引関係

EDINETによる開示を行うため記載を省略しております。