

## 三菱UFJ信託銀行

|                   |     |
|-------------------|-----|
| ■ 主要な経営指標等の推移（連結） | 74  |
| ■ 中間連結財務諸表        | 75  |
| ■ 連結情報            | 87  |
| ■ 主要な経営指標等の推移（単体） | 88  |
| ■ 中間財務諸表          | 89  |
| ■ 営業の概況（単体）       | 99  |
| ■ 信託業務の状況（単体）     | 103 |
| ■ 銀行業務の状況（単体）     | 109 |
| ■ 店舗・人員の状況（単体）    | 117 |
| ■ 資本・株式の状況（単体）    | 118 |

## ● 主要な経営指標等の推移（連結）

### 三菱UFJ信託銀行

(単位：百万円)

| 事業年度                | 平成27年度中間期   | 平成28年度中間期   | 平成29年度中間期   | 平成27年度      | 平成28年度      |
|---------------------|-------------|-------------|-------------|-------------|-------------|
| 連結経常収益              | 359,472     | 360,217     | 427,650     | 717,672     | 758,298     |
| うち連結信託報酬            | 52,029      | 57,046      | 52,269      | 104,043     | 108,418     |
| 連結経常利益              | 115,336     | 105,547     | 120,760     | 238,380     | 179,379     |
| 親会社株主に帰属する中間純利益     | 79,594      | 65,439      | 101,376     | —           | —           |
| 親会社株主に帰属する当期純利益     | —           | —           | —           | 159,583     | 114,308     |
| 連結中間包括利益            | △50,435     | 38,949      | 159,782     | —           | —           |
| 連結包括利益              | —           | —           | —           | 41,222      | 117,607     |
| 連結純資産額              | 2,420,769   | 2,444,507   | 2,567,348   | 2,470,166   | 2,486,626   |
| 連結総資産額              | 38,044,884  | 42,456,889  | 45,366,276  | 45,685,976  | 44,591,967  |
| 1株当たり純資産額           | 662.12円     | 671.31円     | 708.84円     | 675.66円     | 682.28円     |
| 1株当たり中間純利益金額        | 23.51円      | 19.25円      | 29.76円      | —           | —           |
| 1株当たり当期純利益金額        | —           | —           | —           | 47.04円      | 33.62円      |
| 潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額 | 23.49円      | 19.24円      | —           | —           | —           |
| 潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額 | —           | —           | —           | 47.02円      | 33.60円      |
| 連結普通株式等Tier1比率      | 15.08%      | 16.38%      | 16.10%      | 16.01%      | 15.87%      |
| 連結Tier1比率           | 15.59%      | 17.15%      | 17.28%      | 16.82%      | 16.94%      |
| 連結総自己資本比率           | 18.99%      | 20.43%      | 20.55%      | 19.97%      | 19.80%      |
| 従業員数                | 12,425人     | 13,089人     | 13,116人     | 12,602人     | 13,015人     |
| 合算信託財産額             | 187,088,964 | 186,991,620 | 210,852,716 | 197,313,308 | 208,850,000 |

- (注) 1. 当社及び国内連結子会社の消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっています。  
 2. 平成29年度中間連結会計期間の潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載していません。  
 3. 連結自己資本比率は、銀行法第14条の2の規定に基づく平成18年金融庁告示第19号に定められた算式に基づいて、国際統一基準を適用のうえ算出しています。上記告示第19号及び平成26年金融庁告示第7号に基づいて、「連結普通株式等Tier1比率」、「連結Tier1比率」、「連結総自己資本比率」を記載しています。平成27年度中間期の自己資本比率に係る各計数については、リスク・アセットの額の内、フロア調整額算定に必要なパーゼル I における住宅ローン債権を中心とした債権の一部で判明したリスクウエイト等の誤りについて、再計算を行った結果を反映しています。  
 4. 合算信託財産額は、「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連結会社毎の信託財産額（職務分担型共同受託方式により受託している信託財産を含む）を合算しています。なお、連結会社のうち、該当する信託業務を営む会社は当社及び日本マスタートラスト信託銀行株式会社です。

## ● 中間連結財務諸表

当社の中間連結財務諸表、すなわち、中間連結貸借対照表、中間連結損益計算書、中間連結包括利益計算書、中間連結株主資本等変動計算書及び中間連結キャッシュ・フロー計算書は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、有限責任監査法人トーマツの監査証明を受けています。以下の中間連結貸借対照表、中間連結損益計算書、中間連結包括利益計算書、中間連結株主資本等変動計算書及び中間連結キャッシュ・フロー計算書は、上記の中間連結財務諸表に基づいて作成しています。

当社の中間連結財務諸表は、「中間連結財務諸表の用語、様式及び作成方法に関する規則」（平成11年大蔵省令第24号）に基づいて作成していますが、資産及び負債並びに収益及び費用については、「銀行法施行規則」（昭和57年大蔵省令第10号）に定める分類に準じて記載しています。

### 1. 中間連結貸借対照表

|              | (単位：百万円)                   |                            | (単位：百万円)                   |                            |
|--------------|----------------------------|----------------------------|----------------------------|----------------------------|
|              | 平成28年度中間期末<br>(平成28年9月30日) | 平成29年度中間期末<br>(平成29年9月30日) | 平成28年度中間期末<br>(平成28年9月30日) | 平成29年度中間期末<br>(平成29年9月30日) |
| <b>資産の部</b>  |                            |                            | <b>負債の部</b>                |                            |
| 現金預け金        | 9,945,144                  | 12,628,217                 | 預金                         | 14,872,606                 |
| コールローン及び買入手形 | 13,622                     | 78,939                     | 譲渡性預金                      | 4,250,299                  |
| 債券貸借取引支払保証金  | —                          | 119,369                    | コールマネー及び売渡手形               | 674,182                    |
| 買入金銭債権       | 18,985                     | 57,991                     | 売現先勘定                      | 5,289,109                  |
| 特定取引資産       | 555,967                    | 612,533                    | 債券貸借取引受入担保金                | 1,229,262                  |
| 金銭の信託        | 12,892                     | 52,200                     | コマーシャル・ペーパー                | 395,055                    |
| 有価証券         | 16,227,785                 | 14,668,784                 | 特定取引負債                     | 148,504                    |
| 貸出金          | 13,715,776                 | 14,488,887                 | 借入金                        | 2,001,581                  |
| 外国為替         | 49,378                     | 55,492                     | 外国為替                       | 82                         |
| その他資産        | 1,020,070                  | 1,587,473                  | 短期社債                       | 533,999                    |
| 有形固定資産       | 185,372                    | 182,649                    | 社債                         | 824,732                    |
| 無形固定資産       | 121,242                    | 116,683                    | 信託勘定借                      | 8,101,288                  |
| 退職給付に係る資産    | 215,363                    | 288,499                    | その他負債                      | 1,024,136                  |
| 繰延税金資産       | 4,072                      | 2,810                      | 賞与引当金                      | 7,751                      |
| 支払承諾見返       | 405,939                    | 472,558                    | 役員賞与引当金                    | 90                         |
| 貸倒引当金        | △34,724                    | △46,814                    | 株式給付引当金                    | 452                        |
|              |                            |                            | 退職給付に係る負債                  | 4,848                      |
|              |                            |                            | 役員退職慰労引当金                  | 253                        |
|              |                            |                            | 偶発損失引当金                    | 8,343                      |
|              |                            |                            | 繰延税金負債                     | 235,526                    |
|              |                            |                            | 再評価に係る繰延税金負債               | 4,336                      |
|              |                            |                            | 支払承諾                       | 405,939                    |
|              |                            |                            | 負債の部合計                     | 40,012,381                 |
|              |                            |                            | 純資産の部                      |                            |
|              |                            |                            | 資本金                        | 324,279                    |
|              |                            |                            | 資本剰余金                      | 437,438                    |
|              |                            |                            | 利益剰余金                      | 1,029,270                  |
|              |                            |                            | 株主資本合計                     | 1,790,988                  |
|              |                            |                            | その他有価証券評価差額金               | 593,971                    |
|              |                            |                            | 繰延ヘッジ損益                    | △59,620                    |
|              |                            |                            | 土地再評価差額金                   | △1,492                     |
|              |                            |                            | 為替換算調整勘定                   | △5,099                     |
|              |                            |                            | 退職給付に係る調整累計額               | △36,831                    |
|              |                            |                            | その他の包括利益累計額合計              | 490,927                    |
|              |                            |                            | 非支配株主持分                    | 162,591                    |
|              |                            |                            | 純資産の部合計                    | 2,444,507                  |
| 資産の部合計       | 42,456,889                 | 45,366,276                 | 負債及び純資産の部合計                | 42,456,889                 |

## 2. 中間連結損益計算書及び中間連結包括利益計算書

### 中間連結損益計算書

(単位：百万円)

|                 | 平成28年度中間期<br>(平成28年4月1日から<br>平成28年9月30日まで) | 平成29年度中間期<br>(平成29年4月1日から<br>平成29年9月30日まで) |
|-----------------|--|--|
| 経常収益            | 360,217                                    | 427,650                                    |
| 信託報酬            | 57,046                                     | 52,269                                     |
| 資金運用収益          | 109,036                                    | 157,968                                    |
| (うち貸出金利息)       | 46,001                                     | 57,875                                     |
| (うち有価証券利息配当金)   | 57,407                                     | 88,015                                     |
| 役務取引等収益         | 129,610                                    | 138,197                                    |
| 特定取引収益          | 9,808                                      | 13,026                                     |
| その他業務収益         | 30,500                                     | 19,136                                     |
| その他経常収益         | 24,215                                     | 47,051                                     |
| 経常費用            | 254,669                                    | 306,890                                    |
| 資金調達費用          | 58,131                                     | 84,585                                     |
| (うち預金利息)        | 10,959                                     | 14,150                                     |
| 役務取引等費用         | 32,711                                     | 33,759                                     |
| 特定取引費用          | 72   | 54   |
| その他業務費用         | 12,187                                     | 13,057                                     |
| 営業経費            | 147,059                                    | 152,966                                    |
| その他経常費用         | 4,507                                      | 22,466                                     |
| 経常利益            | 105,547                                    | 120,760                                    |
| 特別利益            | 36   | 49,134                                     |
| 固定資産処分益         | 36   | 439  |
| 関連会社株式交換益       | —  | 48,695                                     |
| 特別損失            | 5,284                                      | 15,358                                     |
| 固定資産処分損         | 1,171                                      | 875  |
| 減損損失            | 1,339                                      | 14,483                                     |
| 子会社清算損          | 2,773                                      | —  |
| 税金等調整前中間純利益     | 100,300                                    | 154,536                                    |
| 法人税、住民税及び事業税    | 31,204                                     | 47,228                                     |
| 法人税等調整額         | △1,965                                     | 970  |
| 法人税等合計          | 29,239                                     | 48,199                                     |
| 中間純利益           | 71,060                                     | 106,337                                    |
| 非支配株主に帰属する中間純利益 | 5,620                                      | 4,960                                      |
| 親会社株主に帰属する中間純利益 | 65,439                                     | 101,376                                    |

### 中間連結包括利益計算書

(単位：百万円)

|                  | 平成28年度中間期<br>(平成28年4月1日から<br>平成28年9月30日まで) | 平成29年度中間期<br>(平成29年4月1日から<br>平成29年9月30日まで) |
|------------------|--|--|
| 中間純利益            | 71,060                                     | 106,337                                    |
| その他の包括利益         |  |  |
| その他有価証券評価差額金     | △22,553                                    | 57,825                                     |
| 繰延ヘッジ損益          | 10,221                                     | △9,217                                     |
| 為替換算調整勘定         | △13,387                                    | △3,275                                     |
| 退職給付に係る調整額       | 3,565                                      | 4,137                                      |
| 持分法適用会社に対する持分相当額 | △9,957                                     | 3,974                                      |
| その他の包括利益合計       | △32,111                                    | 53,444                                     |
| 中間包括利益           | 38,949                                     | 159,782                                    |
| (内訳)             |  |  |
| 親会社株主に係る中間包括利益   | 34,755                                     | 154,766                                    |
| 非支配株主に係る中間包括利益   | 4,193                                      | 5,015                                      |

### 3. 中間連結株主資本等変動計算書

平成28年度中間期（平成28年4月1日から平成28年9月30日まで）

（単位：百万円）

|                       | 株主資本    |         |           |           |
|-----------------------|---------|---------|-----------|-----------|
|                       | 資本金     | 資本剰余金   | 利益剰余金     | 株主資本合計    |
| 当期首残高                 | 324,279 | 437,438 | 1,015,211 | 1,776,929 |
| 当中間期変動額               |         |         |           |           |
| 剰余金の配当                |         |         | △49,567   | △49,567   |
| 親会社株主に帰属する中間純利益       |         |         | 65,439    | 65,439    |
| 土地再評価差額金の取崩           |         |         | △1,813    | △1,813    |
| 株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額） |         |         |           |           |
| 当中間期変動額合計             | —       | —       | 14,059    | 14,059    |
| 当中間期末残高               | 324,279 | 437,438 | 1,029,270 | 1,790,988 |

（単位：百万円）

|                       | その他の包括利益累計額      |         |              |              |                  |                       | 非支配株主持分 | 純資産合計     |
|-----------------------|------------------|---------|--------------|--------------|------------------|-----------------------|---------|-----------|
|                       | その他有価証券<br>評価差額金 | 繰延ヘッジ損益 | 土地再評価<br>差額金 | 為替換算<br>調整勘定 | 退職給付に係る<br>調整累計額 | その他の<br>包括利益累計額<br>合計 |         |           |
| 当期首残高                 | 616,241          | △69,839 | △3,305       | 17,312       | △40,610          | 519,798               | 173,438 | 2,470,166 |
| 当中間期変動額               |                  |         |              |              |                  |                       |         |           |
| 剰余金の配当                |                  |         |              |              |                  |                       |         | △49,567   |
| 親会社株主に帰属する中間純利益       |                  |         |              |              |                  |                       |         | 65,439    |
| 土地再評価差額金の取崩           |                  |         |              |              |                  |                       |         | △1,813    |
| 株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額） | △22,270          | 10,219  | 1,813        | △22,412      | 3,779            | △28,870               | △10,847 | △39,718   |
| 当中間期変動額合計             | △22,270          | 10,219  | 1,813        | △22,412      | 3,779            | △28,870               | △10,847 | △25,658   |
| 当中間期末残高               | 593,971          | △59,620 | △1,492       | △5,099       | △36,831          | 490,927               | 162,591 | 2,444,507 |

平成29年度中間期（平成29年4月1日から平成29年9月30日まで）

（単位：百万円）

|                       | 株主資本    |         |           |           |
|-----------------------|---------|---------|-----------|-----------|
|                       | 資本金     | 資本剰余金   | 利益剰余金     | 株主資本合計    |
| 当期首残高                 | 324,279 | 437,438 | 1,043,401 | 1,805,119 |
| 当中間期変動額               |         |         |           |           |
| 新株の発行                 |         | 3,181   |           | 3,181     |
| 剰余金の配当                |         |         | △62,305   | △62,305   |
| 親会社株主に帰属する中間純利益       |         |         | 101,376   | 101,376   |
| 土地再評価差額金の取崩           |         |         | △904      | △904      |
| 連結子会社持分の増減            |         | 3,145   |           | 3,145     |
| 株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額） |         |         |           |           |
| 当中間期変動額合計             | —       | 6,327   | 38,167    | 44,494    |
| 当中間期末残高               | 324,279 | 443,766 | 1,081,568 | 1,849,613 |

（単位：百万円）

|                       | その他の包括利益累計額      |         |              |              |                  |                       | 非支配株主持分 | 純資産合計     |
|-----------------------|------------------|---------|--------------|--------------|------------------|-----------------------|---------|-----------|
|                       | その他有価証券<br>評価差額金 | 繰延ヘッジ損益 | 土地再評価<br>差額金 | 為替換算<br>調整勘定 | 退職給付に係る<br>調整累計額 | その他の<br>包括利益累計額<br>合計 |         |           |
| 当期首残高                 | 531,202          | △1,800  | △1,493       | 1,737        | △15,543          | 514,103               | 167,404 | 2,486,626 |
| 当中間期変動額               |                  |         |              |              |                  |                       |         |           |
| 新株の発行                 |                  |         |              |              |                  |                       |         | 3,181     |
| 剰余金の配当                |                  |         |              |              |                  |                       |         | △62,305   |
| 親会社株主に帰属する中間純利益       |                  |         |              |              |                  |                       |         | 101,376   |
| 土地再評価差額金の取崩           |                  |         |              |              |                  |                       |         | △904      |
| 連結子会社持分の増減            |                  |         |              |              |                  |                       |         | 3,145     |
| 株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額） | 57,598           | △9,183  | 904          | △2,147       | 5,328            | 52,500                | △16,273 | 36,227    |
| 当中間期変動額合計             | 57,598           | △9,183  | 904          | △2,147       | 5,328            | 52,500                | △16,273 | 80,721    |
| 当中間期末残高               | 588,800          | △10,983 | △589         | △409         | △10,214          | 566,603               | 151,130 | 2,567,348 |

#### 4. 中間連結キャッシュ・フロー計算書

(単位：百万円)

(単位：百万円)

|                                  | 平成28年度中間期<br>(平成28年4月1日から<br>平成28年9月30日まで) | 平成29年度中間期<br>(平成29年4月1日から<br>平成29年9月30日まで) | 平成28年度中間期<br>(平成28年4月1日から<br>平成28年9月30日まで) | 平成29年度中間期<br>(平成29年4月1日から<br>平成29年9月30日まで) |
|----------------------------------|--|--|--|--|
| <b>営業活動によるキャッシュ・フロー</b>          |  |  |  |  |
| 税金等調整前中間純利益                      | 100,300                                    | 154,536                                    |  |  |
| 減価償却費                            | 16,764                                     | 17,970                                     |  |  |
| 減損損失                             | 1,339                                      | 14,483                                     |  |  |
| のれん償却額                           | 535  | 677  |  |  |
| 持分法による投資損益(△は益)                  | △2,391                                     | △3,444                                     |  |  |
| 貸倒引当金の増減(△)                      | △3,044                                     | △13,077                                    |  |  |
| 賞与引当金の増減額(△は減少)                  | △410                                       | △783                                       |  |  |
| 役員賞与引当金の増減額(△は減少)                | 35   | △65  |  |  |
| 株式給付引当金の増減額                      | 452  | 31   |  |  |
| 退職給付に係る資産の増減額(△は増加)              | △9,328                                     | △36,004                                    |  |  |
| 退職給付に係る負債の増減額(△は減少)              | 526  | △152                                       |  |  |
| 役員退職慰労引当金の増減額(△は減少)              | △22  | △24  |  |  |
| 偶発損失引当金の増減(△)                    | 187  | 14,285                                     |  |  |
| 資金運用収益                           | △109,036                                   | △157,968                                   |  |  |
| 資金調達費用                           | 58,131                                     | 84,585                                     |  |  |
| 有価証券関係損益(△)                      | △27,945                                    | △71,007                                    |  |  |
| 金銭の信託の運用損益(△は益)                  | 127  | △232                                       |  |  |
| 為替差損益(△は益)                       | 924,271                                    | △248,671                                   |  |  |
| 固定資産処分損益(△は益)                    | 1,134                                      | 436  |  |  |
| 子会社清算損益(△は益)                     | 2,773                                      | —  |  |  |
| 特定取引資産の純増(△) 減                   | △183,272                                   | △57,324                                    |  |  |
| 特定取引負債の純増減(△)                    | △1,683                                     | △17,523                                    |  |  |
| 貸出金の純増(△) 減                      | △368,956                                   | △42,392                                    |  |  |
| 預金の純増減(△)                        | 1,238,585                                  | △1,881,484                                 |  |  |
| 譲渡性預金の純増減(△)                     | △318,424                                   | 304,975                                    |  |  |
| 借入金(劣後特約借入金を除く)の<br>純増減(△)       | 1,547                                      | 855,196                                    |  |  |
| 預け金(現金同等物を除く)の純増(△) 減            | 282,483                                    | △147,183                                   |  |  |
| コールローン等の純増(△) 減                  | 208,147                                    | 184,547                                    |  |  |
| 債券貸借取引支払保証金の純増(△) 減              | 946,860                                    | △4,565                                     |  |  |
| コールマネー等の純増減(△)                   | 564,298                                    | 1,519,398                                  |  |  |
| コマースナル・ペーパーの純増減(△)               | △233,188                                   | 239,091                                    |  |  |
| 債券貸借取引受入担保金の純増減(△)               | 1,002,243                                  | —  |  |  |
| 外国為替(資産)の純増(△) 減                 | △12,503                                    | 21,941                                     |  |  |
| 外国為替(負債)の純増減(△)                  | 54   | 8,400                                      |  |  |
| 短期社債(負債)の純増減(△)                  | 407,006                                    | △90,000                                    |  |  |
| 普通社債発行及び償還による増減(△)               | △22,396                                    | △7,548                                     |  |  |
| 信託勘定借の純増減(△)                     | △5,194,744                                 | △399,598                                   |  |  |
| 資金運用による収入                        | 150,374                                    | 165,045                                    |  |  |
| 資金調達による支出                        | △60,774                                    | △79,161                                    |  |  |
| その他                              | △41,061                                    | △247,781                                   |  |  |
| 小計                               | △681,003                                   | 79,607                                     |  |  |
| 法人税等の支払額                         | △28,606                                    | △31,862                                    |  |  |
| <b>営業活動によるキャッシュ・フロー</b>          | <b>△709,610</b>                            | <b>47,745</b>                              |  |  |
| <b>投資活動によるキャッシュ・フロー</b>          |  |  |  |  |
| 有価証券の取得による支出                     |  |  | △4,867,016                                 | △4,958,842                                 |
| 有価証券の売却による収入                     |  |  | 2,575,992                                  | 2,657,210                                  |
| 有価証券の償還による収入                     |  |  | 2,259,272                                  | 1,498,762                                  |
| 金銭の信託の増加による支出                    |  |  | —  | △44,450                                    |
| 金銭の信託の減少による収入                    |  |  | 0  | 811  |
| 有形固定資産の取得による支出                   |  |  | △8,624                                     | △7,020                                     |
| 有形固定資産の売却による収入                   |  |  | 56   | 972  |
| 無形固定資産の取得による支出                   |  |  | △14,505                                    | △15,440                                    |
| 無形固定資産の売却による収入                   |  |  | —  | 2  |
| 連結の範囲の変更を伴う子会社株式の<br>取得による支出     |  |  | △4,153                                     | △20  |
| その他                              |  |  | △114                                       | △1,237                                     |
| <b>投資活動によるキャッシュ・フロー</b>          |  |  | <b>△59,092</b>                             | <b>△869,252</b>                            |
| <b>財務活動によるキャッシュ・フロー</b>          |  |  |  |  |
| 劣後特約付借入れによる収入                    |  |  | 5,000                                      | 51,000                                     |
| 劣後特約付借入金の返済による支出                 |  |  | △10,000                                    | —  |
| 配当金の支払額                          |  |  | △49,254                                    | △39,916                                    |
| 非支配株主への配当金の支払額                   |  |  | △15,041                                    | △14,961                                    |
| <b>財務活動によるキャッシュ・フロー</b>          |  |  | <b>△69,295</b>                             | <b>△3,877</b>                              |
| <b>現金及び現金同等物に係る換算差額</b>          |  |  | <b>△79,818</b>                             | <b>△2,324</b>                              |
| <b>現金及び現金同等物の増減額(△は減少)</b>       |  |  | <b>△917,816</b>                            | <b>△827,709</b>                            |
| <b>現金及び現金同等物の期首残高</b>            |  |  | <b>10,346,133</b>                          | <b>12,769,943</b>                          |
| <b>連結除外に伴う現金及び現金同等物の<br/>減少額</b> |  |  | <b>△151</b>                                | <b>△1,599</b>                              |
| <b>現金及び現金同等物の中間期末残高</b>          |  |  | <b>9,428,165</b>                           | <b>11,940,634</b>                          |

(右上に続く)

## 注記事項（平成29年度中間期）

### （中間連結財務諸表作成のための基本となる重要な事項）

#### 1. 連結の範囲に関する事項

- (1) 連結子会社 49社  
 主要な会社名  
 三菱UFJ不動産販売株式会社  
 日本マスタートラスト信託銀行株式会社  
 エム・ユー投資顧問株式会社  
 三菱UFJ国際投信株式会社  
 Mitsubishi UFJ Trust International Limited  
 Mitsubishi UFJ Baillie Gifford Asset Management Limited  
 Mitsubishi UFJ Investor Services & Banking (Luxembourg) S.A.  
 MUFG Lux Management Company S.A.  
 Mitsubishi UFJ Asset Management (UK) Limited  
 Mitsubishi UFJ Fund Services Holdings Limited  
 （連結の範囲の変更）  
 エム・ユー・トラスト不動産管理株式会社を、買収により、当中間連結会計期間から連結の範囲に含めております。  
 また、MUFG Investor Services (US), LLC他2社は現物配当等により、当中間連結会計期間より連結の範囲から除いております。
- (2) 非連結子会社  
 該当事項はありません。
- (3) 他の会社等の議決権の過半数を自己の計算において所有しているにもかかわらず子会社としなかった当該他の会社等の名称  
 株式会社ハイジア  
 （子会社としなかった理由）  
 土地信託事業において受益者のために信託建物を管理する目的で設立された管理会社であり、傘下に入れる目的で設立されたものではないことから、子会社として取り扱っておりません。

#### 2. 持分法の適用に関する事項

- (1) 持分法適用の非連結子会社  
 該当事項はありません。
- (2) 持分法適用の関連会社 8社  
 主要な会社名  
 AMP Capital Holdings Limited  
 （持分法適用の範囲の変更）  
 追加出資により、1社を当中間連結会計期間から持分法適用の範囲に含めております。  
 また、Aberdeen Asset Management PLC他3社は、Standard Life plcと株式交換による経営統合を行い、当社の議決権比率が低下したことにより、当中間連結会計期間より持分法適用の範囲から除いております。
- (3) 持分法非適用の非連結子会社  
 該当事項はありません。
- (4) 持分法非適用の関連会社  
 該当事項はありません。
- (5) 他の会社等の議決権の百分の二十以上百分の五十以下を自己の計算において所有しているにもかかわらず関連会社としなかった当該他の会社等の名称  
 該当事項はありません。

#### 3. 連結子会社の中間決算日等に関する事項

- (1) 連結子会社の中間決算日は次のとおりであります。
- |       |     |
|-------|-----|
| 6月末日  | 30社 |
| 7月24日 | 1社  |
| 9月末日  | 18社 |
- (2) 連結子会社は、それぞれの中間決算日の中間財務諸表により連結しております。  
 なお、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。

#### 4. 会計方針に関する事項

- (1) 特定取引資産・負債の評価基準及び収益・費用の計上基準  
 金利、通貨の価格、金融商品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」に計上するとともに、当該取引からの損益（利息、売却損益及び評価損益）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。  
 特定取引資産及び特定取引負債の評価は、時価法により行っております。
- (2) 有価証券の評価基準及び評価方法  
 (イ)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）、その他有価証券については原則として中間連結決算日の市場価格等に基づく時価法（売却原価は移動平均法により算定）、ただし時価を把握することが極めて困難と認められるものについては移動平均法による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、時価ヘッジの適用により損益に反映させた額を除き、全部純資産直入法により処理しております。  
 (ロ)有価証券運用を主目的とする単独運用の金銭の信託の信託財産の構成物である有価証券の評価は、時価法により行っております。  
 なお、運用目的及び満期保有目的以外の金銭の信託の信託財産の構成物である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。

- (3) デリバティブ取引の評価基準及び評価方法  
 デリバティブ取引（特定取引目的の取引を除く）の評価は、原則として時価法により行っております。
- (4) 固定資産の減価償却の方法  
 ①有形固定資産（リース資産を除く）  
 有形固定資産は、主として定率法により償却し、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。  
 また、主な耐用年数は次のとおりであります。
- |     |         |
|-----|---------|
| 建物  | 15年～50年 |
| その他 | 4年～15年  |
- ②無形固定資産（リース資産を除く）  
 無形固定資産は、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、当社及び連結子会社で定める利用可能期間（主として5年）にわたって、のれんについてはその効果の及ぶ期間にわたって償却しております。
- ③リース資産  
 所有権移転外ファイナンス・リース取引に係る「有形固定資産」及び「無形固定資産」中のリース資産は、リース期間を耐用年数とした定額法により償却しております。なお、残存価額については、リース契約上に残価保証の取決めがあるものは当該残価保証額とし、それ以外のものは零としております。
- (5) 貸倒引当金の計上基準  
 当社及び国内連結子会社の貸倒引当金は、予め定めている資産の自己査定基準及び償却・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、手形交換所における取引停止処分等、法的・形式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。）に対する債権及び実質的に経営破綻に陥っている債務者（以下、「実質破綻先」という。）に対する債権については、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が可能と認められる額を控除し、その残額を計上しております。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。）に対する債権のうち、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ることができない債権については、債権額から担保の処分可能見込額及び保証による回収が可能と認められる額を控除し、その残額のうち、債務者の支払能力を総合的に判断して必要と認められる額を計上しております。破綻懸念先及び今後の管理に注意を要する債務者に対する債権のうち、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・フローを当初の約定利率で割り引いた金額と債権の帳簿価額との差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等から算出した貸倒引当率を債権額に乗じた額を計上しております。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じる損失見込額を特定海外債権引当金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、営業部及び審査所管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署が査定結果を監査しております。  
 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6,148百万円あります。  
 その他の連結子会社の貸倒引当金は、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る額を、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計上しております。
- (6) 賞与引当金の計上基準  
 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。
- (7) 役員賞与引当金の計上基準  
 役員賞与引当金は、役員への賞与の支払いに備えるため、役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。
- (8) 株式給付引当金の計上基準  
 株式給付引当金は、当社の取締役等への株式報酬制度における報酬支払いに備えるため、取締役等に対する報酬の支給見込額のうち、当中間連結会計期間末までに発生していると認められる額を計上しております。
- (9) 役員退職慰労引当金の計上基準  
 連結子会社の役員退職慰労引当金は、役員への退職慰労金の支払いに備えるため、役員に対する退職慰労金の支給見込額のうち、当中間連結会計期間末までに発生していると認められる額を計上しております。
- (10) 偶発損失引当金の計上基準  
 偶発損失引当金は、オフバランス取引や信託取引等に関して偶発的に発生する損失に備えるため、将来発生する可能性のある損失の見積額を計上しております。
- (11) 退職給付に係る会計処理の方法  
 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当中間連結会計期間末までの期間に帰属させる方法については給付算定基準によっております。また、過去勤務費用及び数理計算上の差異の費用処理方法は次のとおりであります。  
 過去勤務費用： 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（10～15年）による定額法により費用処理  
 数理計算上の差異：各連結会計年度の発生時における従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（10～15年）による定額法により按分した額を、それぞれ発生時の翌連結会計年度から費用処理  
 なお、一部の連結子会社は、退職給付に係る負債及び退職給付費用の計算に、退職給付に係る当中間連結会計期間末の自己都合要支給額を退職給付債務とする方法を用いた簡便法を適用しております。
- (12) 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準  
 当社の外貨建資産・負債及び海外支店勘定は、取得時等の為替相場による円換算額を付す関連会社株式を除き、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。

連結子会社の外貨建資産・負債については、それぞれの間接決算日等の為替相場により換算しております。

(13)重要なヘッジ会計の方法

(イ)金利リスク・ヘッジ

当社の金融資産・負債から生じる金利リスクを対象とするヘッジ会計のヘッジ対象を識別する方法は、業種別監査委員会報告第24号「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」(平成14年2月13日日本公認会計士協会。以下、「業種別監査委員会報告第24号」という。)及び会計制度委員会報告第14号「金融商品会計に関する実務指針」(平成12年1月31日日本公認会計士協会)に示されている取扱いによる包括ヘッジ又は個別ヘッジによっております。ヘッジ会計の方法は、金利スワップ等の特別処理の要件を満たす一部の取引は特別処理によっており、それ以外の場合には繰延ヘッジによっております。

固定金利の預金・貸出金等の相場変動を相殺するヘッジにおいては、個別に又は業種別監査委員会報告第24号に基づき一定の残存期間毎にグルーピングしてヘッジ対象を識別し、金利スワップ取引等をヘッジ手段として指定しております。その他有価証券に区分している固定金利の債券の相場変動を相殺するヘッジにおいては、同一種類毎にヘッジ対象を識別し、金利スワップ取引等をヘッジ手段として指定しております。ヘッジ対象とヘッジ手段に関する重要な条件がほぼ同一となるようなヘッジ指定を行っているため、高い有効性があるとみなしており、これをもって有効性の判定に代えております。

変動金利の預金・貸出金等及び短期固定金利の預金・貸出金等に係る予定取引のキャッシュ・フローを固定するヘッジにおいては、業種別監査委員会報告第24号に基づき金利インデックス及び一定の金利改定期間毎にグルーピングしてヘッジ対象を識別し、金利スワップ取引等をヘッジ手段として指定しております。ヘッジ対象とヘッジ手段に関する重要な条件がほぼ同一となるようなヘッジ指定を行っているため、高い有効性があるとみなしており、これをもって有効性の判定に代えているほか、金利変動要素の相関関係の検証により有効性の評価を行っております。

(ロ)為替変動リスク・ヘッジ

当社の外貨建の金融資産・負債から生じる為替変動リスクに対するヘッジ会計については、業種別監査委員会報告第25号「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」(平成14年7月29日日本公認会計士協会。以下、「業種別監査委員会報告第25号」という。)に基づき、外貨建金銭債権債務等を通貨毎にグルーピングしてヘッジ対象を識別し、同一通貨の通貨スワップ取引及び為替予約(資金関連スワップ取引)をヘッジ手段として指定しており、ヘッジ会計の方法は、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、外貨建その他有価証券(債券以外)の為替変動リスクをヘッジするため、同一通貨の外貨建金銭債務及び為替予約をヘッジ手段として包括ヘッジを行っており、時価ヘッジを適用しております。

(ハ)株価変動リスク・ヘッジ

当社のその他有価証券のうち、政策投資目的で保有する株式の相場変動リスクをヘッジするため、トータル・リターン・スワップをヘッジ手段として個別ヘッジを行っており、ヘッジの有効性評価については、ヘッジ対象の時価変動等とヘッジ手段の時価変動等との相関関係を検証する方法により行っております。ヘッジ会計の方法は、時価ヘッジによっております。

(ニ)連結会社間取引等

デリバティブ取引のうち連結会社間及び特定取引勘定とそれ以外の勘定との間(又は内部部門間)の内部取引については、ヘッジ手段として指定している金利スワップ取引及び通貨スワップ取引等に対して、業種別監査委員会報告第24号及び同第25号に基づき、恣意性を排除し厳格なヘッジ運営が可能と認められる対外カバー取引の基準に準拠した運営を行っているため、当該金利スワップ取引及び通貨スワップ取引等から生じる損益又は評価差額を消去せずに当中間連結会計期間の損益として処理し、あるいは繰延処理を行っております。

(14)中間連結キャッシュ・フロー計算書における資金の範囲

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」のうち、定期性預け金と譲渡性預け金以外のものであります。

(15)消費税等の会計処理

当社及び国内連結子会社の消費税及び地方消費税(以下、「消費税等」という。)の会計処理は、税抜方式によっております。

なお、資産に係る控除対象外消費税等は、主として発生した連結会計年度の費用に計上しております。

(16)連結納税制度の適用

当社及び一部の国内連結子会社は、株式会社三菱UFJフィナンシャル・グループを連結納税親会社とする連結納税制度を適用しております。

(17)手形割引及び再割引の会計処理

手形割引及び再割引は、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。

(追加情報)

グループの「機能別再編」の一環として、三菱UFJ証券ホールディングス株式会社及び株式会社三菱東京UFJ銀行が保有する三菱UFJ国際投信株式会社の持分を譲り受け、平成30年4月1日を予定日として同社を完全子会社化する方針を、平成29年5月15日開催の当社の取締役会で決議いたしました。なお、具体的な方法等については検討中であり、現時点で影響額を見積ることは出来ません。

(中間連結貸借対照表関係)

1. 関連会社の株式又は出資金の総額

|     |           |
|-----|-----------|
| 株式  | 35,471百万円 |
| 出資金 | 8,644百万円  |

2. 消費貸借契約により借り入れている有価証券及び現先取引により受け入れている有価証券のうち、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は次のとおりであります。

|                               |              |
|-------------------------------|--------------|
| 再担保に差し入れている有価証券               | 1,174,365百万円 |
| 当中間連結会計期間末に当該処分をせずに所有している有価証券 | 22,135百万円    |

手形割引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、その額面金額は次のとおりであります。

|  |        |
|--|--------|
|  | 821百万円 |
|--|--------|

3. 貸出金のうち、破綻先債権額及び延滞債権額は次のとおりであります。

|        |           |
|--------|-----------|
| 破綻先債権額 | 510百万円    |
| 延滞債権額  | 12,130百万円 |

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。

4. 貸出金のうち、3ヵ月以上延滞債権額は次のとおりであります。

|            |       |
|------------|-------|
| 3ヵ月以上延滞債権額 | 86百万円 |
|------------|-------|

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ヵ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。

5. 貸出金のうち、貸出条件緩和債権額は次のとおりであります。

|           |           |
|-----------|-----------|
| 貸出条件緩和債権額 | 30,630百万円 |
|-----------|-----------|

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。

6. 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次のとおりであります。

|     |           |
|-----|-----------|
| 合計額 | 43,358百万円 |
|-----|-----------|

なお、上記3. から6. に掲げた債権額は、貸倒引当金控除前の金額であります。

7. 担保に供している資産は次のとおりであります。

|       |              |
|-------|--------------|
| 現金預け金 | 5,071百万円     |
| 有価証券  | 806,423百万円   |
| 貸出金   | 2,423,783百万円 |

担保資産に対応する債務

|      |              |
|------|--------------|
| 預金   | 42,600百万円    |
| 借入金  | 2,543,133百万円 |
| 支払承諾 | 11,495百万円    |

上記のほか、為替決済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、次のものを差し入れております。

|      |              |
|------|--------------|
| 有価証券 | 1,567,197百万円 |
| 貸出金  | 458,551百万円   |

また、売現先取引による買戻し条件付の売却を行っている資産は次のとおりであります。

|        |              |
|--------|--------------|
| 有価証券   | 4,866,309百万円 |
| 対応する債務 |              |

|       |              |
|-------|--------------|
| 売現先勘定 | 4,859,868百万円 |
|-------|--------------|

8. 連結した特別目的会社のノンリコース債務は次のとおりであります。

|                   |        |
|-------------------|--------|
| ノンリコース債務          |        |
| 借入金               | 338百万円 |
| 当該ノンリコース債務に対応する資産 |        |
| 貸出金               | 338百万円 |

9. 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し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次のとおりであります。

|         |              |
|---------|--------------|
| 融資未実行残高 | 8,193,721百万円 |
|---------|--------------|

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子会社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、当社及び連結子会社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られ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。

10. 土地の再評価に関する法律(平成10年3月31日法律第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「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、平成13年12月31日及び平成14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 政令第119号)第2条第4号に定める「地価税法第16条に規定する地価税の課税価格の計算の基礎となる土地の価額を算定するために国税庁長官が定めて公表した方法により算定した価額」及び同条第1号に定める「近隣の地価公示法第6条に規定する標準地について同条の規定により公示された価格」に実行価格修正及び時点修正等を行って算定したほか、同条第5号に定める不動産鑑定士による鑑定評価に時点修正を行って算定。

11. 有形固定資産の減価償却累計額  
減価償却累計額 156,776百万円
12. 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が含まれております。  
劣後特約付借入金 287,500百万円
13. 社債には、劣後特約付社債が含まれております。  
劣後特約付社債 240,000百万円
14. 有価証券中の社債のうち、有価証券の私募(金融商品取引法第2条第3項)による社債に対する保証債務の額 28,520百万円
15. 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、次のとおりであります。  
金銭信託 6,521,892百万円

## (中間連結損益計算書関係)

1. その他経常収益には、次のものを含んでおります。  
株式等売却益 13,660百万円  
貸倒引当金戻入益 13,049百万円
2. その他経常費用には、次のものを含んでおります。  
偶発損失引当金繰入額 14,350百万円
3. 「関連会社株式交換益」は、当社の持分法適用関連会社であったAberdeen Asset Management PLCが、平成29年8月14日付でStandard Life plcと株式交換による経営統合を行ったことに伴い発生した交換益であります。
4. 「減損損失」には、受託財産部門の海外連結子会社に係る顧客関連無形資産の減損損失11,120百万円を含んでおります。当社は事業区分をもとに、概ね独立したキャッシュ・フローを生み出す最小の単位ごとに資産のグルーピングを行っております。買収時の顧客基盤の減減を背景に、将来キャッシュ・フローを見積り直した結果、当初に想定していた将来キャッシュ・フロー見積期間にわたって回収可能性が認められないと判断したため、帳簿価額を回収可能価額まで減額し、当該減少額を減損損失として計上しております。回収可能価額は、使用価値により測定しており、将来キャッシュ・フローを11.9%で割り引いて算出しております。

## (中間連結株主資本等変動計算書関係)

1. 発行済株式の種類及び総数並びに自己株式の種類及び株式数に関する事項  
(単位：千株)

|       | 当連結会計<br>年度期首<br>株式数 | 当中間連結<br>会計期間増加<br>株式数 | 当中間連結<br>会計期間減少<br>株式数 | 当中間連結<br>会計期間末<br>株式数 | 摘要 |
|-------|----------------------|------------------------|------------------------|-----------------------|----|
| 発行済株式 |                      |                        |                        |                       |    |
| 普通株式  | 3,399,187            | 9,474                  | —                      | 3,408,662             | 注  |
| 合計    | 3,399,187            | 9,474                  | —                      | 3,408,662             |    |

(注) 普通株式の発行済株式総数の増加9,474千株は、株式会社三菱UFJフィナンシャル・グループが保有するMitsubishi UFJ Investor Services & Banking (Luxembourg) S.A.の普通株式285千株を当社が承継するために実施した吸収分割に伴い、発行交付したものであります。

## 2. 配当に関する事項

- (1) 当中間連結会計期間中の配当金支払額  
①金銭による配当金支払額

| (決議)                   | 株式の種類 | 配当金の<br>総額<br>(百万円) | 1株当たり<br>配当額(円) | 基準日            | 効力発生日          |
|------------------------|-------|---------------------|-----------------|----------------|----------------|
| 平成29年<br>5月15日<br>取締役会 | 普通株式  | 24,100              | 7.09            | 平成29年<br>3月31日 | 平成29年<br>5月16日 |
| 平成29年<br>7月27日<br>取締役会 | 普通株式  | 15,816              | 4.64            | —              | 平成29年<br>8月2日  |

## ②金銭以外による配当金支払額

| (決議)                   | 株式の<br>種類 | 配当<br>財産の<br>種類 | 配当財産の<br>帳簿価額<br>(百万円) | 1株当たり<br>配当額(円) | 基準日 | 効力発生日         |
|------------------------|-----------|-----------------|------------------------|-----------------|-----|---------------|
| 平成29年<br>3月28日<br>取締役会 | 普通<br>株式  | 有価<br>証券        | 24,182                 | —               | —   | 平成29年<br>7月1日 |

(注) 1. 中間連結株主資本等変動計算書の「剰余金の配当」には、配当財産の帳簿価額から「その他の包括利益累計額」に相当する金額1,793百万円を控除した22,388百万円を計上しております。

2. 配当財産のすべてを普通株式の唯一の株主である株式会社三菱UFJフィナンシャル・グループに対して割り当てることとしており、1株当たり配当額は定めておりません。

- (2) 基準日が当中間連結会計期間に属する配当のうち、配当の効力発生日が当中間連結会計期間の末日後となるもの

| (決議)                    | 株式の種類 | 配当金の<br>総額<br>(百万円) | 配当の<br>原資 | 1株<br>当たり<br>配当額(円) | 基準日            | 効力発生日           |
|-------------------------|-------|---------------------|-----------|---------------------|----------------|-----------------|
| 平成29年<br>11月14日<br>取締役会 | 普通株式  | 19,020              | 利益<br>剰余金 | 5.58                | 平成29年<br>9月30日 | 平成29年<br>11月15日 |

## (中間連結キャッシュ・フロー計算書関係)

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

|              |               |
|--------------|---------------|
| 平成29年9月30日現在 |               |
| 現金預け金勘定      | 12,628,217百万円 |
| 定期性預け金       | △687,582百万円   |
| 現金及び現金同等物    | 11,940,634百万円 |

## (リース取引関係)

オペレーティング・リース取引

オペレーティング・リース取引のうち解約不能のものに係る未経過リース料(借手側)

|     |           |
|-----|-----------|
| 1年内 | 8,084百万円  |
| 1年超 | 19,736百万円 |
| 合計  | 27,820百万円 |

(貸手側)

|     |          |
|-----|----------|
| 1年内 | 343百万円   |
| 1年超 | 943百万円   |
| 合計  | 1,287百万円 |

## (金融商品関係)

金融商品の時価等に関する事項

中間連結貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額は、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められる非上場株式等は、次表には含めておりません(注2)参照。

(単位：百万円)

|                      | 中間連結貸借<br>対照表計上額 | 時価         | 差額      |
|----------------------|------------------|------------|---------|
| (1) 現金預け金(*1)        | 12,628,217       | 12,628,217 | —       |
| (2) コールローン及び買入手形(*1) | 78,939           | 78,939     | —       |
| (3) 債券貸借取引支払保証金      | 119,369          | 119,369    | —       |
| (4) 買入金銭債権           | 57,991           | 57,991     | —       |
| (5) 特定取引資産           |                  |            |         |
| 売買目的有価証券             | 494,542          | 494,542    | —       |
| (6) 金銭的信託            | 52,200           | 52,200     | —       |
| (7) 有価証券             |                  |            |         |
| 満期保有目的の債券            | 16,905           | 17,010     | 105     |
| その他有価証券              | 14,560,755       | 14,560,755 | —       |
| (8) 貸出金              | 14,488,887       |            |         |
| 貸倒引当金(*1)            | △45,393          |            |         |
|                      | 14,443,494       | 14,792,509 | 349,015 |
| (9) 外国為替(*1)         | 55,492           | 55,492     | —       |
| 資産計                  | 42,507,908       | 42,857,030 | 349,121 |
| (1) 預金               | 14,892,371       | 14,898,497 | 6,125   |
| (2) 譲渡性預金            | 5,013,986        | 5,013,987  | 0       |
| (3) コールマネー及び売渡手形     | 165,785          | 165,785    | —       |
| (4) 売現先勘定            | 6,190,559        | 6,190,559  | —       |
| (5) コマーシャル・ペーパー      | 779,148          | 779,148    | —       |
| (6) 借入金              | 3,464,281        | 3,475,866  | 11,585  |
| (7) 外国為替             | 46,117           | 46,117     | —       |
| (8) 短期社債             | 149,999          | 149,999    | —       |
| (9) 社債               | 865,170          | 874,118    | 8,947   |
| (10) 信託勘定借           | 9,494,282        | 9,494,282  | —       |
| (11) その他負債(*2)       | 63,200           | 63,200     | —       |
| 負債計                  | 41,124,903       | 41,151,563 | 26,659  |
| デリバティブ取引(*3)         |                  |            |         |
| ヘッジ会計が適用されていないもの     | 14,201           | 14,201     | —       |
| ヘッジ会計が適用されているもの      | 45,769           | 45,769     | —       |
| デリバティブ取引計            | 59,971           | 59,971     | —       |

(\*1) 貸出金に対応する一般貸倒引当金及び個別貸倒引当金を控除しております。なお、貸出金以外の科目については、対応する貸倒引当金の重要性が乏しいため、貸倒引当金を控除しておりません。

(\*2) デリバティブ取引は含めておりません。その他負債のうち、金融商品で時価開示の対象となるものを表示しております。

(\*3) 特定取引資産・負債及びその他資産・負債に計上しているデリバティブ取引を一括して表示しております。デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しております。

(注1) 金融商品の時価の算定方法

資産

(1) 現金預け金

満期のない預け金については、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。満期のある預け金については、残存期間が短期間(1年以内)であり、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。

(2) コールローン及び買入手形、及び(3)債券貸借取引支払保証金

これらは、約定期間が短期間(1年以内)であり、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。

(4) 買入金銭債権

買入金銭債権については、取引金融機関等から提示された価格によっております。

(5) 特定取引資産

特定取引目的で保有している債券等の有価証券については、市場価格又は取引金融機関等から提示された価格によっております。一部の有価証券については、見積将来キャッシュ・フローを市場金利で割り引いて現在価値を算定しております。

(6) 金銭の信託

有価証券運用を主目的とする単独運用の金銭の信託の信託財産の構成物である有価証券については、取引金融機関等から提示された価格によっております。

なお、保有目的ごとの金銭の信託に関する注記事項については「(金銭の信託関係)」に記載しております。

(7) 有価証券

株式は取引所の価格によっております。債券は市場価格、取引金融機関等から提示された価格又は合理的に算定された価格等によっております。投資信託は、公表されている基準価格又は取引金融機関等から提示された価格によっております。

私算債のうち、市場価格又は取引金融機関等から提示された価格のないものについては、債務不履行リスク、担保・保証による回収額及び保証料を反映した見積将来キャッシュ・フローを市場金利で割り引いて現在価値を算定しております。

変動利付国債は、国債の利回り等から見積もった将来キャッシュ・フローを、同利回りに基づく割引率に、内包されるオプション価値及び過去の市場実績に基づいた流動性プレミアムを考慮した金利で割り引いた現在価値を時価としております。

また、証券化商品のうち、企業向け貸出債権を裏付資産とした証券化商品の一部については、裏付資産を分析し、倒産確率、期限前償還率等を用いて将来キャッシュ・フローを見積り、過去の市場実績等に基づいた流動性プレミアムを加味した利回りにより割り引いた価格と、取引金融機関等より入手した価格の双方を勘案して算出した価額を時価としております。その他の証券化商品については、取引金融機関等から入手する価格によっております。

(8) 貸出金

法人向けの貸出金については、債務不履行リスク及び担保・保証による回収見込額等を反映した見積将来キャッシュ・フローを市場金利で割り引いて現在価値を算定しております。なお、法人向けの貸出金のうち、破綻先、実質破綻先及び破綻懸念先に対する債権等については、見積将来キャッシュ・フローの現在価値又は担保・保証による回収見込額等に基づいて貸倒見積高を算定しているため、時価は中間連結決算日における中間連結貸借対照表上の債権等計上額から貸倒引当金計上額を控除した金額に近似しており、当該価額を時価としております。また、金利スワップの特例処理又は為替予約等の振当処理の対象とされた貸出金については、当該金利スワップ又は為替予約等の時価を反映しております。

個人向けの住宅ローン等については、貸出金の種類及び期間に基づく区分毎に、元利金の合計額を同様の新規貸付を行った場合に想定される適用利率で割り引く方法等により時価を算定しております。

(9) 外国為替

外国為替は、他の銀行に対する外貨預け金(外国他店預け)及び輸入手形による手形貸付(取立外国為替)であります。これらは、満期のない預け金又は約定期間が短期間(1年以内)であり、それぞれ時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。

負債

(1) 預金

要求払預金については、中間連結決算日に要求された場合の支払額(帳簿価額)を時価とみなしております。また、定期預金のうち、変動金利によるものは、短期間で市場金利を反映するため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。固定金利によるものは、一定の期間毎に区分して、将来キャッシュ・フローを割り引いて現在価値を算定しております。その割引率は、新規に預金を受け入れる際に使用する利率を用いております。なお、残存期間が短期間(1年以内)のものは、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。

(2) 譲渡性預金

譲渡性預金は、将来キャッシュ・フローを割り引いて現在価値を算定しております。その割引率は、新規に預金を受け入れる際に使用する利率を用いております。なお、残存期間が短期間(1年以内)のものは、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。

(3) コールマネー及び売渡手形、(4) 売現先勘定、及び(5) コマーシャル・ペーパー

これらは、約定期間が短期間(1年以内)であり、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。

(6) 借入金

借入金は、一定の期間毎に区分した将来キャッシュ・フローを当社の信用リスクを反映した利率で割り引いて現在価値を算定しております。上記のうち金利スワップの特例処理の対象となるものについては、当該金利スワップの時価を反映しております。なお、残存期間が短期間(1年以内)のものは、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。

(7) 外国為替

外国為替のうち、他の銀行から受け入れた外貨預り金及び非居住者円預り金(外国他店預り)は満期のない預り金であり、これらの時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。

(8) 短期社債

短期社債は、約定期間が短期間(1年以内)であり、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。

(9) 社債

社債のうち、市場価格のあるものは、市場価格に基づいて算定した価額を時価としております。市場価格のないものは、一定の期間毎に区分した将来キャッシュ・フローを当社の信用リスクを反映した利率で割り引いて現在価値を算定しております。上記のうち金利スワップの特例処理又は為替予約等の振当処理の対象となるものについては、当該金利スワップ又は為替予約等の時価を反映しております。また、残存期間が短期間(1年以内)のものは、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。

(10) 信託勘定債

信託勘定債は、満期のない預り金であり、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。

(11) その他負債

その他負債は、約定期間が短期間(1年以内)であり、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。

デリバティブ取引

デリバティブ取引については、「(デリバティブ取引関係)」に記載しております。

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品の中間連結貸借対照表計上額は次のとおりであり、金融商品の時価情報の「資産(7) その他有価証券」には含まれておりません。

(単位：百万円)

| 区分              | 中間連結貸借対照表計上額 |
|-----------------|--------------|
| ① 非上場株式(*1)(*3) | 37,266       |
| ② 組合出資金(*2)(*3) | 9,370        |
| ③ その他           | 370          |
| 合計              | 47,007       |

(\*1) 非上場株式については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから時価開示の対象とはしていません。

(\*2) 組合出資金は、投資事業組合等であり、これらは時価を把握することが極めて困難と認められるものであり、時価開示の対象とはしていません。

(\*3) 当中間連結会計期間において、非上場株式4百万円、組合出資金107百万円の減損処理を行っております。

(有価証券関係)

\*1. 中間連結貸借対照表の「有価証券」のほか、「買入金銭債権」中の有価証券及び有価証券に準ずるものを含めて記載しております。

\*2. 「子会社株式及び関連会社株式」については、中間財務諸表における注記事項として記載しております。

1. 満期保有目的の債券

(単位：百万円)

|                        | 種類  | 中間連結貸借対照表計上額 | 時価     | 差額  |
|------------------------|-----|--------------|--------|-----|
| 時価が中間連結貸借対照表計上額を超えるもの  | 国債  | —            | —      | —   |
|                        | 地方債 | —            | —      | —   |
|                        | 社債  | —            | —      | —   |
|                        | その他 | 16,905       | 17,010 | 105 |
|                        | 小計  | 16,905       | 17,010 | 105 |
| 時価が中間連結貸借対照表計上額を超えないもの | 国債  | —            | —      | —   |
|                        | 地方債 | —            | —      | —   |
|                        | 社債  | —            | —      | —   |
|                        | その他 | —            | —      | —   |
|                        | 小計  | —            | —      | —   |
| 合計                     |     | 16,905       | 17,010 | 105 |

## 2. その他有価証券

(単位：百万円)

| 種類                           | 中間連結貸借<br>対照表計上額 | 取得原価       | 差額         |         |
|------------------------------|------------------|------------|------------|---------|
| 中間連結貸借対照表計上額が<br>取得原価を超えるもの  | 株式               | 1,075,042  | 441,502    | 633,539 |
|                              | 債券               | 3,196,477  | 3,160,946  | 35,531  |
|                              | 国債               | 3,027,521  | 2,993,948  | 33,573  |
|                              | 地方債              | 68         | 64         | 4       |
|                              | 社債               | 168,887    | 166,934    | 1,953   |
|                              | その他              | 6,168,750  | 5,910,845  | 257,905 |
|                              | 外国株式             | 111,463    | 102,453    | 9,010   |
|                              | 外国債券             | 5,085,072  | 4,980,016  | 105,056 |
|                              | その他              | 972,214    | 828,375    | 143,838 |
|                              | 小計               | 10,440,270 | 9,513,294  | 926,976 |
| 中間連結貸借対照表計上額が<br>取得原価を超えないもの | 株式               | 26,105     | 28,773     | △2,667  |
|                              | 債券               | 713,768    | 716,383    | △2,615  |
|                              | 国債               | 650,833    | 652,809    | △1,976  |
|                              | 地方債              | —          | —          | —       |
|                              | 社債               | 62,935     | 63,573     | △638    |
|                              | その他              | 3,438,601  | 3,515,419  | △76,817 |
|                              | 外国株式             | 1          | 1          | —       |
|                              | 外国債券             | 2,869,499  | 2,901,454  | △31,954 |
|                              | その他              | 569,100    | 613,964    | △44,863 |
|                              | 小計               | 4,178,476  | 4,260,577  | △82,100 |
| 合計                           |                  | 14,618,747 | 13,773,871 | 844,875 |

(注) 上記の差額のうち、時価ヘッジの適用により損益に反映させた額は3,979百万円(収益)であります。

## 3. 減損処理を行った有価証券

売買目的有価証券以外の有価証券(時価を把握することが極めて困難なものを除く)のうち、当該有価証券の時価が取得原価に比べて著しく下落しており、時価が取得原価まで回復する見込みがあると認められないものについては、当該時価をもって中間連結貸借対照表計上額とするとともに、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ける減損処理額は、102百万円(うち、株式87百万円、その他14百万円)であります。

また、時価が「著しく下落した」と判断するための基準は、予め定めている資産の自己査定基準に有価証券の発行会社の区分毎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50%以上下落 |

なお、破綻先とは、破産、特別清算、手形交換所における取引停止処分等、法的・形式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、実質的に経営破綻に陥っている発行会社、破綻懸念先とは、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であります。要注意先とは、今後の管理に注意を要する発行会社であります。正常先とは、上記破綻先、実質破綻先、破綻懸念先及び要注意先以外の発行会社であります。

## (金銭の信託関係)

## 1. 満期保有目的の金銭の信託

該当事項はありません。

## 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)

| 中間連結貸借<br>対照表計上額 | 取得原価   | 差額     | うち中間連結<br>貸借対照表<br>計上額が<br>取得原価を<br>超えるもの | うち中間連結<br>貸借対照表<br>計上額が<br>取得原価を<br>超えないもの |
|------------------|--------|--------|---|--|
| その他の<br>金銭の信託    | 37,665 | 40,000 | △2,334                                    | —  |

(注) 「うち中間連結貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの」「うち中間連結貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの」はそれぞれ「差額」の内訳であります。

## (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)

|   |         |
|---|---------|
| 評価差額  | 834,553 |
| その他有価証券                                       | 836,887 |
| その他の金銭の信託                                     | △2,334  |
| (△)繰延税金負債                                     | 244,748 |
| その他有価証券評価差額金(持分相当額調整前)                        | 589,804 |
| (△)非支配株主持分相当額                                 | 996     |
| (+)持分法適用会社が所有するその他有価証券に係る<br>評価差額金のうち親会社持分相当額 | △8      |
| その他有価証券評価差額金                                  | 588,800 |

(注) 1. 評価差額からは、時価ヘッジの適用により損益に反映された額3,979百万円(収益)を除外しております。

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31百万円(益)及び時価を把握することが極めて困難と認められる外貨建その他有価証券に係る為替換算差額4,039百万円(損)を含めております。

## (デリバティブ取引関係)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引について、取引の対象物の種類ごとの中間連結決算日における契約額又は契約において定められた元本相当額、時価及び評価損益並びに当該時価の算定方法は、次のとおりであります。なお、契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

## (1) 金利関連取引

(単位：百万円)

|           | 契約額等      |           | 時価      | 評価損益    |
|-----------|-----------|-----------|---------|---------|
|           | うち1年超     |           |         |         |
| 金融商品取引所   |           |           |         |         |
| 金利先物      |           |           |         |         |
| 売建        | —         | —         | —       | —       |
| 買建        | —         | —         | —       | —       |
| 金利オプション   |           |           |         |         |
| 売建        | —         | —         | —       | —       |
| 買建        | —         | —         | —       | —       |
| 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 | 4,088,655 | 3,713,770 | 44,883  | 44,883  |
| 受取変動・支払固定 | 4,121,233 | 3,700,564 | △27,033 | △27,033 |
| 受取変動・支払変動 | 265,294   | 265,294   | △16     | △16     |
| 受取固定・支払固定 | 5,254     | 5,254     | 421     | 421     |
| 金利オプション   |           |           |         |         |
| 売建        | —         | —         | —       | —       |
| 買建        | —         | —         | —       | —       |
| キャップ・フロアー |           |           |         |         |
| 売建        | 19,500    | 19,500    | △117    | 606     |
| 買建        | 25,222    | 25,222    | △92     | △453    |
| 金利スワップション |           |           |         |         |
| 売建        | —         | —         | —       | —       |
| 買建        | —         | —         | —       | —       |
| その他       |           |           |         |         |
| 売建        | —         | —         | —       | —       |
| 買建        | —         | —         | —       | —       |
| 合計        | —         | —         | 18,045  | 18,408  |

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

## 2. 時価の算定

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：百万円)

|         | 契約額等       |         | 時価       | 評価損益     |
|---------|------------|---------|----------|----------|
|         | うち1年超      |         |          |          |
| 金融商品取引所 |            |         |          |          |
| 通貨先物    |            |         |          |          |
| 売建      | -          | -       | -        | -        |
| 買建      | -          | -       | -        | -        |
| 通貨オプション |            |         |          |          |
| 売建      | -          | -       | -        | -        |
| 買建      | -          | -       | -        | -        |
| 店頭      |            |         |          |          |
| 通貨スワップ  | 864,986    | 696,222 | 1,621    | 1,621    |
| 為替予約    |            |         |          |          |
| 売建      | 14,235,846 | 111,832 | △203,399 | △203,399 |
| 買建      | 14,474,973 | 113,852 | 196,919  | 196,919  |
| 通貨オプション |            |         |          |          |
| 売建      | 235,404    | 42,877  | △3,733   | 896      |
| 買建      | 227,654    | 41,059  | 3,814    | △1,373   |
| その他     |            |         |          |          |
| 売建      | -          | -       | -        | -        |
| 買建      | -          | -       | -        | -        |
| 合計      | -          | -       | △4,778   | △5,335   |

(注) 1. 上記取引については時価評価を行い、評価損益を中間連結損益計算書に計上しております。  
2. 時価の算定  
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) 株式関連取引 (単位：百万円)

|               | 契約額等    |   | 時価   | 評価損益 |
|---------------|---------|---|------|------|
|               | うち1年超   |   |      |      |
| 金融商品取引所       |         |   |      |      |
| 株式指数先物        |         |   |      |      |
| 売建            | 5,554   | - | △220 | △220 |
| 買建            | -       | - | -    | -    |
| 株式指数オプション     |         |   |      |      |
| 売建            | -       | - | -    | -    |
| 買建            | 100,008 | - | 837  | △78  |
| 店頭            |         |   |      |      |
| 有価証券店頭オプション   |         |   |      |      |
| 売建            | -       | - | -    | -    |
| 買建            | -       | - | -    | -    |
| 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      | -       | - | -    | -    |
| 短期変動金利受取・     |         |   |      |      |
| 株価指数変化率支払     | -       | - | -    | -    |
| その他           |         |   |      |      |
| 売建            | -       | - | -    | -    |
| 買建            | -       | - | -    | -    |
| 合計            | -       | - | 617  | △298 |

(注) 1. 上記取引については時価評価を行い、評価損益を中間連結損益計算書に計上しております。  
2. 時価の算定  
大阪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：百万円)

|           | 契約額等    |   | 時価  | 評価損益 |
|-----------|---------|---|-----|------|
|           | うち1年超   |   |     |      |
| 金融商品取引所   |         |   |     |      |
| 債券先物      |         |   |     |      |
| 売建        | -       | - | -   | -    |
| 買建        | -       | - | -   | -    |
| 債券先物オプション |         |   |     |      |
| 売建        | -       | - | -   | -    |
| 買建        | 252,560 | - | 316 | △188 |
| 店頭        |         |   |     |      |
| 債券店頭オプション |         |   |     |      |
| 売建        | -       | - | -   | -    |
| 買建        | -       | - | -   | -    |
| その他       |         |   |     |      |
| 売建        | -       | - | -   | -    |
| 買建        | -       | - | -   | -    |
| 合計        | -       | - | 316 | △188 |

(注) 1. 上記取引については時価評価を行い、評価損益を中間連結損益計算書に計上しております。  
2. 時価の算定  
大阪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  
該当事項はありません。

(6) クレジット・デリバティブ取引  
該当事項はありません。

## (1株当たり情報)

## 1. 1株当たり純資産額及び算定上の基礎

|                    |              |
|--------------------|--------------|
| 1株当たり純資産額          | 708円84銭      |
| (算定上の基礎)           |              |
| 純資産の部の合計額          | 2,567,348百万円 |
| 純資産の部の合計額から控除する金額  | 151,130百万円   |
| うち非支配株主持分          | 151,130百万円   |
| 普通株式に係る中間期末の純資産額   | 2,416,217百万円 |
| 1株当たり純資産額の算定に用いられた |              |
| 中間期末の普通株式の数        | 3,408,662千株  |

## 2. 1株当たり中間純利益金額及び算定上の基礎並びに潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額及び算定上の基礎

|   |             |
|---|-------------|
| (1) 1株当たり中間純利益金額                                | 29円76銭      |
| (算定上の基礎)  |             |
| 親会社株主に帰属する中間純利益                                 | 101,376百万円  |
| 普通株主に帰属しない金額                                    | 一百万円        |
| 普通株式に係る親会社株主に帰属する中間純利益                          | 101,376百万円  |
| 普通株式の期中平均株式数                                    | 3,405,555千株 |
| (2) 潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額                         | -           |
| 潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。 |             |

## (重要な後発事象)

当社と株式会社三菱東京UFJ銀行（以下、「商業銀行」という。）は、関係当局の認可を前提として、平成30年4月16日を効力発生日とした、当社の国内本支店において記帳されている法人貸出等業務を商業銀行が承継する吸収分割契約、及び当社の海外拠点（ニューヨーク、ロンドン、香港及びシンガポール）において記帳されている法人貸出等業務を商業銀行が譲り受ける事業譲渡契約を平成29年10月31日付で締結いたしました。（以下、本吸収分割契約に基づく吸収分割と本事業譲渡契約に基づく事業譲渡は「本件組織再編」という。）

## 本件組織再編の目的

MUFGグループでは、シンプル・スピーディー・トランスパレントなグループ・体経営を通じ、顧客・役員・株主その他のステイクホルダーに最善の価値を提供すること、及び課題解決型のビジネスを展開することで、持続的な成長とより良い社会の実現に貢献すること等を目的とした「MUFG再創造イニシアティブ」を公表いたしました。

その一環として、本件組織再編により、法人のお客さまにグループ一体で対応する体制の構築、及びグループ各社の使命と機能分担をより明確化します（グループの「機能別再編」）。

なお、当社の貸出金の連結貸借対照表計上額（当中間連結会計期間末14兆4,888億円）の大部分を承継及び譲渡する予定ですが、連結貸借対照表への影響額は、本件組織再編の効力発生日が平成30年4月16日であるため、現時点においては未確定であります。

## セグメント情報等

平成28年度中間期

### 事業の種類別セグメント情報

(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  | 302,677    | 57,539   | 360,217    | —        | 360,217    |
| (2) セグメント間の内部経常収益 | 28,203     | 1,830    | 30,033     | (30,033) | —          |
| 計                 | 330,880    | 59,369   | 390,250    | (30,033) | 360,217    |
| 経常費用              | 215,054    | 45,231   | 260,286    | (5,616)  | 254,669    |
| 経常利益              | 115,826    | 14,138   | 129,964    | (24,416) | 105,547    |
| 資産                | 42,239,679 | 287,597  | 42,527,276 | (70,387) | 42,456,889 |

(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. 金融関連業その他には、投資信託委託業務、投資顧問業務、証券業務等が属しております。

平成29年度中間期

### 事業の種類別セグメント情報

(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  | 371,528    | 56,122   | 427,650    | —        | 427,650    |
| (2) セグメント間の内部経常収益 | 23,171     | 1,829    | 25,000     | (25,000) | —          |
| 計                 | 394,699    | 57,951   | 452,651    | (25,000) | 427,650    |
| 経常費用              | 268,708    | 43,832   | 312,540    | (5,649)  | 306,890    |
| 経常利益              | 125,991    | 14,119   | 140,110    | (19,350) | 120,760    |
| 資産                | 45,046,402 | 391,805  | 45,438,208 | (71,931) | 45,366,276 |

(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. 金融関連業その他には、投資信託委託業務、投資顧問業務、証券業務等が属しております。

「セグメント情報等の開示に関する会計基準」に基づくセグメント情報は以下のとおりです。

#### 1. セグメント情報

##### 1. 報告セグメントの概要

当社グループの報告セグメントは、業務執行の意思決定機関である経営会議が、経営資源の配分の決定及び業績を評価するために、定期的に検討を行う対象となっているものであります。

当社グループは、顧客特性・業務特性に応じて事業部門を設置しており、各事業部門は対象の顧客・業務について、包括的な戦略を立案し、事業活動を展開しております。従って、当社グループは、顧客・事業別のセグメントから構成されており、「リテール部門」「法人ビジネス部門」「受託財産部門」「市場国際部門」及び「その他」を報告セグメントとしております。

リテール部門：個人に対する金融サービスの提供

法人ビジネス部門：法人に対する金融、不動産及び証券代行に関する総合的なサービスの提供

受託財産部門：企業年金、公的年金、公的資金及び投資信託などの各種資金に関する資金運用・管理サービスの提供

市場国際部門：海外支店・子会社ネットワークを通じての金融サービスの提供及び国内外の有価証券投資などの市場運用業務・資金繰りの管理

その他：上記各部門に属さない管理業務等

##### 2. 報告セグメントごとの連結業務粗利益及び連結実質業務純益の金額の算定方法

報告されているセグメントの会計処理の方法は、「中間連結財務諸表作成のための基本となる重要な事項」における記載と概ね同一であります。複数のセグメントに跨る収益・費用の計上方法は、市場実勢価格をベースとした社内管理会計基準に基づいております。

3. 報告セグメントごとの連結業務粗利益及び連結実質業務純益の金額に関する情報

(単位：百万円)

|          | リテール部門 | 法人ビジネス部門 | 受託財産部門 |        |        | 市場国際部門 | その他    | 合計      |         |
|----------|--------|----------|--------|--------|--------|--------|--------|---------|---------|
|          |        |          | 法人事業   | 不動産事業  | 証券代行事業 |        |        |         |         |
| 連結業務粗利益  | 37,457 | 68,649   | 34,871 | 13,955 | 19,823 | 90,815 | 47,763 | 4,361   | 249,047 |
| 単体       | 29,908 | 63,753   | 34,862 | 11,094 | 17,796 | 41,855 | 44,955 | 23,197  | 203,670 |
| 金利収支     | 6,574  | 22,075   | 22,075 | —      | —      | —      | 39,761 | 22,837  | 91,248  |
| 非金利収支    | 23,333 | 41,678   | 12,786 | 11,094 | 17,796 | 41,855 | 5,194  | 360     | 112,421 |
| 子会社等     | 7,548  | 4,896    | 9      | 2,860  | 2,026  | 48,960 | 2,807  | △18,836 | 45,377  |
| 経費       | 35,281 | 24,718   | 9,818  | 6,922  | 7,977  | 57,238 | 12,710 | 16,942  | 146,891 |
| 連結実質業務純益 | 2,175  | 43,931   | 25,052 | 7,033  | 11,845 | 33,577 | 35,053 | △12,580 | 102,156 |

- (注) 1. 一般企業の売上高に代えて、連結業務粗利益を記載しております。  
 2. 連結業務粗利益は、信託勘定償却前であります。  
 3. 連結実質業務純益は、一般貸倒引当金繰入前・信託勘定償却前であります。  
 4. 当社は、内部管理上、資産及び負債をセグメントに配分していないため、報告セグメント別の資産及び負債を記載しておりません。  
 5. 法人ビジネス部門については、「法人事業」「不動産事業」「証券代行事業」の各事業内訳を開示しております。  
 6. 米国金融規制に対応するため、平成28年7月及び平成29年7月に当社の米国子会社を、株式会社三菱東京UFJ銀行及び株式会社三菱UFJフィナンシャル・グループが出資する米国中間持株会社（Intermediate Holding Company、以下「IHC」という。）に移管しております。当該移管した会社の業績については引き続き受託財産部門に含めております。

4. 報告セグメント合計額と中間連結財務諸表計上額との差額及び当該差額の主な内容(差異調整に関する事項)

(単位：百万円)

|                     | 金額      |
|---------------------|---------|
| 連結実質業務純益の報告セグメント合計  | 102,156 |
| IHC移管会社の実質業務純益(△は益) | △34     |
| 一般貸倒引当金繰入額          | —       |
| 信託勘定償却              | —       |
| 与信関係費用              | △7,755  |
| 貸倒引当金戻入益            | 13,049  |
| 偶発損失引当金戻入益(与信関連)    | —       |
| 償却債権取立益             | 526     |
| 株式等関係損益             | 11,800  |
| 持分法による投資損益          | 3,444   |
| その他の臨時損益            | △2,426  |
| 中間連結損益計算書の経常利益      | 120,760 |

(注) 差異調整につきましては連結実質業務純益と中間連結損益計算書の経常利益計上額との差異について記載しております。

2. 関連情報

1. サービスごとの情報

報告セグメントに係る情報と同様であるため、記載を省略しております。

2. 地域ごとの情報

(1) 経常収益

(単位：百万円)

| 日本      | 米国     | 欧州     | アジア・オセアニア | その他    | 合計      |
|---------|--------|--------|-----------|--------|---------|
| 349,476 | 23,424 | 26,439 | 12,885    | 15,426 | 427,650 |

- (注) 1. 一般企業の売上高に代えて、経常収益を記載しております。  
 2. 経常収益は、当社の本店及び連結子会社の所在地を基盤として、国又は地域に分類しております。

(2) 有形固定資産

当社グループは、本邦に所在している有形固定資産の金額が中間連結貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、記載を省略しております。

3. 主要な顧客ごとの情報

特定の顧客に対する経常収益で中間連結損益計算書の経常収益の10%以上を占めるものがないため、記載を省略しております。

3. 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

固定資産の減損損失は、報告セグメントに配分しておりません。当該減損損失は14,483百万円であります。

4. 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

(単位：百万円)

|         | リテール部門 | 法人ビジネス部門 | 受託財産部門 |       |        | 市場国際部門 | その他 | 合計 |        |
|---------|--------|----------|--------|-------|--------|--------|-----|----|--------|
|         |        |          | 法人事業   | 不動産事業 | 証券代行事業 |        |     |    |        |
| 当中間期償却額 | —      | 22       | —      | —     | 22     | 655    | —   | —  | 677    |
| 当中間期末残高 | —      | 587      | —      | —     | 587    | 16,566 | —   | —  | 17,153 |

5. 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

## ● 連結情報

### リスク管理債権の状況

リスク管理債権額については、部分直接償却後の金額を記載しています。

#### (1) リスク管理債権

(単位：億円)

|                  | 平成28年度中間期末   | 平成29年度中間期末   |
|------------------|--------------|--------------|
| 破綻先債権額           | 5            | 5            |
| 延滞債権額            | 105          | 121          |
| 3カ月以上延滞債権額       | 2            | 0            |
| 貸出条件緩和債権額        | 271          | 306          |
| <b>合計</b>        | <b>384</b>   | <b>433</b>   |
| 貸出金残高            | 137,157      | 144,888      |
| <b>貸出金に占める比率</b> | <b>0.28%</b> | <b>0.29%</b> |

#### (2) リスク管理債権に対する引当率

(単位：億円)

|                     | 平成28年度中間期末    | 平成29年度中間期末     |
|---------------------|---------------|----------------|
| 貸倒引当金(A)            | 347           | 468            |
| リスク管理債権(B)          | 384           | 433            |
| <b>引当率(A) / (B)</b> | <b>90.25%</b> | <b>107.97%</b> |

(注) 貸倒引当金には、リスク管理債権以外の債権に対応する引当金が含まれているほか、担保・保証等による保全については考慮されていません。

#### (3) 地域別リスク管理債権

(単位：億円)

|           | 平成28年度中間期末 |            |            |            |            | 平成29年度中間期末 |            |            |            |            |
|-----------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|
|           | 破綻先債権額     | 延滞債権額      | 3カ月以上延滞債権額 | 貸出条件緩和債権額  | 合計         | 破綻先債権額     | 延滞債権額      | 3カ月以上延滞債権額 | 貸出条件緩和債権額  | 合計         |
| <b>国内</b> | <b>5</b>   | <b>105</b> | <b>2</b>   | <b>271</b> | <b>384</b> | <b>5</b>   | <b>83</b>  | <b>0</b>   | <b>301</b> | <b>390</b> |
| <b>海外</b> | <b>—</b>   | <b>—</b>   | <b>—</b>   | <b>—</b>   | <b>—</b>   | <b>—</b>   | <b>37</b>  | <b>—</b>   | <b>4</b>   | <b>42</b>  |
| アジア       | —          | —          | —          | —          | —          | —          | —          | —          | 4          | 4          |
| タイ        | —          | —          | —          | —          | —          | —          | —          | —          | 4          | 4          |
| 米州        | —          | —          | —          | —          | —          | —          | 37         | —          | —          | 37         |
| 欧州、中近東他   | —          | —          | —          | —          | —          | —          | —          | —          | —          | —          |
| <b>合計</b> | <b>5</b>   | <b>105</b> | <b>2</b>   | <b>271</b> | <b>384</b> | <b>5</b>   | <b>121</b> | <b>0</b>   | <b>306</b> | <b>433</b> |

(注) 「国内」・「海外」は、債務者の所在地により区分しています。

#### (4) 業種別リスク管理債権

(単位：億円)

|            | 平成28年度中間期末 |            |            |            |            | 平成29年度中間期末 |            |            |            |            |
|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|
|            | 破綻先債権額     | 延滞債権額      | 3カ月以上延滞債権額 | 貸出条件緩和債権額  | 合計         | 破綻先債権額     | 延滞債権額      | 3カ月以上延滞債権額 | 貸出条件緩和債権額  | 合計         |
| <b>国内</b>  | <b>5</b>   | <b>105</b> | <b>2</b>   | <b>271</b> | <b>384</b> | <b>5</b>   | <b>83</b>  | <b>0</b>   | <b>301</b> | <b>390</b> |
| 製造業        | —          | 17         | —          | 206        | 223        | —          | 14         | —          | 243        | 257        |
| 建設業        | —          | —          | —          | 6          | 6          | —          | —          | —          | 6          | 6          |
| 卸売業、小売業    | —          | 13         | —          | 0          | 14         | —          | 0          | —          | —          | 0          |
| 金融業、保険業    | —          | —          | —          | —          | —          | —          | —          | —          | —          | —          |
| 不動産業、物品賃貸業 | 0          | 31         | 1          | 40         | 74         | —          | 18         | 0          | 34         | 53         |
| 各種サービス業    | —          | 2          | —          | 0          | 2          | —          | 2          | —          | —          | 2          |
| その他        | —          | 3          | —          | —          | 3          | —          | 11         | —          | 0          | 12         |
| 消費者        | 5          | 36         | 0          | 17         | 60         | 5          | 36         | 0          | 16         | 57         |
| <b>海外</b>  | <b>—</b>   | <b>—</b>   | <b>—</b>   | <b>—</b>   | <b>—</b>   | <b>—</b>   | <b>37</b>  | <b>—</b>   | <b>4</b>   | <b>42</b>  |
| 金融機関       | —          | —          | —          | —          | —          | —          | —          | —          | —          | —          |
| 商工業        | —          | —          | —          | —          | —          | —          | 37         | —          | 4          | 42         |
| その他        | —          | —          | —          | —          | —          | —          | —          | —          | —          | —          |
| <b>合計</b>  | <b>5</b>   | <b>105</b> | <b>2</b>   | <b>271</b> | <b>384</b> | <b>5</b>   | <b>121</b> | <b>0</b>   | <b>306</b> | <b>433</b> |

(注) 「国内」・「海外」は、債務者の所在地により区分しています。

## ● 主要な経営指標等の推移（単体）

### 三菱UFJ信託銀行

（単位：百万円）

| 回次<br>事業年度                    | 第11期中<br>平成27年度中間期          | 第12期中<br>平成28年度中間期          | 第13期中<br>平成29年度中間期           | 第11期<br>平成27年度              | 第12期<br>平成28年度              |
|-------------------------------|-----------------------------|-----------------------------|------------------------------|-----------------------------|-----------------------------|
| 経常収益                          | 288,591                     | 302,086                     | 365,558                      | 571,346                     | 622,721                     |
| うち信託報酬                        | 45,638                      | 49,897                      | 45,789                       | 90,917                      | 94,645                      |
| 経常利益                          | 99,549                      | 105,515                     | 121,682                      | 206,507                     | 164,488                     |
| 中間純利益                         | 70,359                      | 75,728                      | 126,096                      | —                           | —                           |
| 当期純利益                         | —                           | —                           | —                            | 159,981                     | 120,254                     |
| 資本金                           | 324,279                     | 324,279                     | 324,279                      | 324,279                     | 324,279                     |
| 発行済株式総数                       | 普通株式<br>3,399,187千株         | 普通株式<br>3,399,187千株         | 普通株式<br>3,408,662千株          | 普通株式<br>3,399,187千株         | 普通株式<br>3,399,187千株         |
| 純資産額                          | 2,111,170                   | 2,247,597                   | 2,366,051                    | 2,233,512                   | 2,251,695                   |
| 総資産額                          | 35,478,530                  | 40,213,919                  | 42,092,092                   | 40,320,504                  | 41,336,180                  |
| 預金残高                          | 12,944,485                  | 14,532,416                  | 14,448,165                   | 13,345,415                  | 16,334,673                  |
| 貸出金残高                         | 12,960,358                  | 13,573,206                  | 14,307,608                   | 13,192,538                  | 14,283,249                  |
| 有価証券残高                        | 15,247,201                  | 16,273,032                  | 14,779,034                   | 17,426,047                  | 13,829,880                  |
| 1株当たり配当額                      | 普通株式 10.87円                 | 普通株式 14.47円                 | 普通株式 10.22円                  | 普通株式 21.48円                 | 普通株式 26.22円                 |
| 単体普通株式等Tier1比率                | 14.53%                      | 17.17%                      | 16.11%                       | 16.58%                      | 16.35%                      |
| 単体Tier1比率                     | 15.03%                      | 18.07%                      | 17.25%                       | 17.45%                      | 17.45%                      |
| 単体総自己資本比率                     | 18.90%                      | 21.81%                      | 20.56%                       | 21.08%                      | 20.48%                      |
| 従業員数                          | 6,989人                      | 7,052人                      | 7,158人                       | 6,963人                      | 6,959人                      |
| 信託財産額<br>(含 職務分担型共同受託財産)      | 81,197,994<br>(150,574,136) | 82,890,520<br>(149,180,508) | 102,487,529<br>(170,742,609) | 82,820,257<br>(153,710,390) | 92,207,290<br>(160,666,790) |
| 信託勘定貸出金残高<br>(含 職務分担型共同受託財産)  | 125,233<br>(125,233)        | 172,918<br>(172,918)        | 267,275<br>(267,275)         | 150,571<br>(150,571)        | 204,237<br>(204,237)        |
| 信託勘定有価証券残高<br>(含 職務分担型共同受託財産) | 406,905<br>(54,402,498)     | 535,574<br>(52,375,631)     | 496,052<br>(52,166,441)      | 504,586<br>(53,614,888)     | 475,566<br>(53,054,465)     |
| 総資産利益率(ROA)                   |                             |                             |                              |                             |                             |
| 経常利益率                         | 0.57%                       | 0.52%                       | 0.58%                        | 0.58%                       | 0.40%                       |
| 中間(当期)純利益率                    | 0.40%                       | 0.37%                       | 0.60%                        | 0.45%                       | 0.29%                       |
| 資本利益率(ROE)                    |                             |                             |                              |                             |                             |
| 経常利益率                         | 9.20%                       | 9.39%                       | 10.51%                       | 9.31%                       | 7.33%                       |
| 中間(当期)純利益率                    | 6.50%                       | 6.74%                       | 10.89%                       | 7.21%                       | 5.36%                       |

- (注) 1. 消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっています。  
 2. 1株当たり配当額のうち臨時配当を第11期中に4.28円、第11期に9.31円、第12期中に8.91円、第12期に13.57円、第13期中に4.64円含めています。  
 3. 第12期中、第12期、第13期中に現物配当を実施していますが、1株当たり配当額に含めていません。  
 4. 単体自己資本比率は、銀行法第14条の2の規定に基づく平成18年金融庁告示第19号に定められた算式に基づいて、国際統一基準を適用のうえ算出しています。上記告示第19号及び平成26年金融庁告示第7号に基づいて、「単体普通株式等Tier1比率」、「単体Tier1比率」、「単体総自己資本比率」を記載しています。平成27年度中間期の自己資本比率に係る各計数については、リスク・アセットの額の内、フロア調整額算定に必要なパーゼルIにおける住宅ローン債権を中心とした債権の一部で判明したリスクウェイト等の誤りについて、再計算を行った結果を反映しています。  
 5. 信託財産額、信託勘定貸出金残高及び信託勘定有価証券残高には、( )内に職務分担型共同受託方式により受託している信託財産（「職務分担型共同受託財産」という。）を含んだ金額を記載しています。  
 6. 総資産利益率=  $\frac{\text{利益} / \text{期中日数} \times \text{年間日数}}{\text{総資産（除く支払承諾見返）平均残高}} \times 100$   
 7. 資本利益率=  $\frac{(\text{利益} - \text{優先株式配当金総額}) / \text{期中日数} \times \text{年間日数}}{\{(\text{期首純資産の部合計} - \text{期首発行済優先株式数} \times \text{発行価額}) + (\text{期末純資産の部合計} - \text{期末発行済優先株式数} \times \text{発行価額})\} / 2} \times 100$



## ● 中間財務諸表

当社の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書及び中間株主資本等変動計算書は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、有限責任監査法人トーマツの監査証明を受けています。以下の中間貸借対照表、中間損益計算書及び中間株主資本等変動計算書は、上記の中間財務諸表に基づいて作成しています。

当社の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）に基づいて作成していますが、資産及び負債並びに収益及び費用については、「銀行法施行規則」（昭和57年大蔵省令第10号）に定める分類に準じて記載しています。

### 1. 中間貸借対照表

|               | (単位：百万円)                   |                            |                    | (単位：百万円)                   |                            |
|---------------|----------------------------|----------------------------|--------------------|----------------------------|----------------------------|
|               | 平成28年度中間期末<br>(平成28年9月30日) | 平成29年度中間期末<br>(平成29年9月30日) |                    | 平成28年度中間期末<br>(平成28年9月30日) | 平成29年度中間期末<br>(平成29年9月30日) |
| <b>資産の部</b>   |                            |                            | <b>負債の部</b>        |                            |                            |
| 現金預け金         | 8,078,391                  | 9,975,660                  | 預金                 | 14,532,416                 | 14,448,165                 |
| コールローン        | 13,622                     | 78,939                     | 譲渡性預金              | 4,253,469                  | 5,015,916                  |
| 債券貸借取引支払保証金   | —                          | 119,369                    | コールマネー             | 674,182                    | 365,785                    |
| 買入金銭債権        | 251                        | 15                         | 売現先勘定              | 5,289,109                  | 6,190,559                  |
| 特定取引資産        | 555,967                    | 612,533                    | 債券貸借取引受入担保金        | 2,029,250                  | 399,908                    |
| 金銭の信託         | 12,892                     | 52,200                     | コマーシャル・ペーパー        | 395,055                    | 779,148                    |
| 有価証券          | 16,273,032                 | 14,779,034                 | 特定取引負債             | 148,504                    | 122,085                    |
| 貸出金           | 13,573,206                 | 14,307,608                 | 借入金                | 2,105,034                  | 3,554,644                  |
| 外国為替          | 49,378                     | 55,492                     | 外国為替               | 500                        | 46,585                     |
| その他資産         | 832,269                    | 1,382,928                  | 短期社債               | 533,999                    | 149,999                    |
| その他の資産        | 832,269                    | 1,382,928                  | 社債                 | 824,732                    | 865,170                    |
| 有形固定資産        | 148,159                    | 143,024                    | 信託勘定借              | 5,616,214                  | 6,576,576                  |
| 無形固定資産        | 59,063                     | 65,477                     | その他負債              | 912,339                    | 660,219                    |
| 前払年金費用        | 267,356                    | 302,341                    | 未払法人税等             | 10,759                     | 16,215                     |
| 支払承諾見返        | 384,442                    | 263,739                    | リース債務              | 130                        | 114                        |
| 貸倒引当金         | △34,114                    | △46,272                    | 資産除去債務             | 1,826                      | 1,970                      |
|               |                            |                            | その他の負債             | 899,623                    | 641,919                    |
|               |                            |                            | 賞与引当金              | 4,791                      | 4,876                      |
|               |                            |                            | 役員賞与引当金            | 19                         | 20                         |
|               |                            |                            | 株式給付引当金            | 452                        | 3,447                      |
|               |                            |                            | 退職給付引当金            | —                          | 879                        |
|               |                            |                            | 偶発損失引当金            | 8,059                      | 21,755                     |
|               |                            |                            | 繰延税金負債             | 249,411                    | 252,323                    |
|               |                            |                            | 再評価に係る繰延税金負債       | 4,336                      | 4,232                      |
|               |                            |                            | 支払承諾               | 384,442                    | 263,739                    |
|               |                            |                            | <b>負債の部合計</b>      | <b>37,966,321</b>          | <b>39,726,041</b>          |
|               |                            |                            | <b>純資産の部</b>       |                            |                            |
|               |                            |                            | 資本金                | 324,279                    | 324,279                    |
|               |                            |                            | 資本剰余金              | 422,083                    | 425,265                    |
|               |                            |                            | 資本準備金              | 250,619                    | 250,619                    |
|               |                            |                            | その他資本剰余金           | 171,464                    | 174,646                    |
|               |                            |                            | <b>利益剰余金</b>       | <b>968,191</b>             | <b>1,040,686</b>           |
|               |                            |                            | 利益準備金              | 73,714                     | 73,714                     |
|               |                            |                            | その他利益剰余金           | 894,477                    | 966,972                    |
|               |                            |                            | 退職慰労基金             | 710                        | 710                        |
|               |                            |                            | 別途積立金              | 138,495                    | 138,495                    |
|               |                            |                            | 繰越利益剰余金            | 755,272                    | 827,767                    |
|               |                            |                            | <b>株主資本合計</b>      | <b>1,714,554</b>           | <b>1,790,231</b>           |
|               |                            |                            | その他有価証券評価差額金       | 592,310                    | 586,366                    |
|               |                            |                            | 繰延ヘッジ損益            | △57,774                    | △9,957                     |
|               |                            |                            | 土地再評価差額金           | △1,492                     | △589                       |
|               |                            |                            | <b>評価・換算差額等合計</b>  | <b>533,042</b>             | <b>575,820</b>             |
|               |                            |                            | <b>純資産の部合計</b>     | <b>2,247,597</b>           | <b>2,366,051</b>           |
| <b>資産の部合計</b> | <b>40,213,919</b>          | <b>42,092,092</b>          | <b>負債及び純資産の部合計</b> | <b>40,213,919</b>          | <b>42,092,092</b>          |

## 2. 中間損益計算書

(単位：百万円)

|               | 平成28年度中間期<br>(平成28年4月1日から<br>平成28年9月30日まで) | 平成29年度中間期<br>(平成29年4月1日から<br>平成29年9月30日まで) |
|---------------|--|--|
| 経常収益          | 302,086                                    | 365,558                                    |
| 信託報酬          | 49,897                                     | 45,789                                     |
| 資金運用収益        | 128,844                                    | 178,472                                    |
| (うち貸出金利息)     | 46,004                                     | 57,879                                     |
| (うち有価証券利息配当金) | 76,679                                     | 107,868                                    |
| 役務取引等収益       | 65,576                                     | 70,956                                     |
| 特定取引収益        | 7,307                                      | 10,422                                     |
| その他業務収益       | 28,304                                     | 16,043                                     |
| その他経常収益       | 22,155                                     | 43,873                                     |
| 経常費用          | 196,570                                    | 243,875                                    |
| 資金調達費用        | 59,848                                     | 87,233                                     |
| (うち預金利息)      | 11,465                                     | 15,683                                     |
| 役務取引等費用       | 15,527                                     | 17,733                                     |
| 特定取引費用        | 60   | 54   |
| その他業務費用       | 12,117                                     | 13,002                                     |
| 営業経費          | 104,909                                    | 105,152                                    |
| その他経常費用       | 4,108                                      | 20,699                                     |
| 経常利益          | 105,515                                    | 121,682                                    |
| 特別利益          | 36   | 53,250                                     |
| 特別損失          | 5,593                                      | 4,225                                      |
| 税引前中間純利益      | 99,959                                     | 170,707                                    |
| 法人税、住民税及び事業税  | 25,485                                     | 42,173                                     |
| 法人税等調整額       | △1,255                                     | 2,437                                      |
| 法人税等合計        | 24,230                                     | 44,611                                     |
| 中間純利益         | 75,728                                     | 126,096                                    |

### 3. 中間株主資本等変動計算書

平成28年度中間期（平成28年4月1日から平成28年9月30日まで）

（単位：百万円）

|                       | 株主資本    |         |          |         |        |          |         |         |         | 株主資本合計    |
|-----------------------|---------|---------|----------|---------|--------|----------|---------|---------|---------|-----------|
|                       | 資本金     | 資本剰余金   |          |         | 利益準備金  | 利益剰余金    |         |         | 利益剰余金合計 |           |
|                       |         | 資本準備金   | その他資本剰余金 | 資本剰余金合計 |        | その他利益剰余金 |         |         |         |           |
|                       |         |         |          |         |        | 退職慰労基金   | 別途積立金   | 繰越利益剰余金 |         |           |
| 当期首残高                 | 324,279 | 250,619 | 171,464  | 422,083 | 73,714 | 710      | 138,495 | 730,923 | 943,842 | 1,690,205 |
| 当中間期変動額               |         |         |          |         |        |          |         |         |         |           |
| 剰余金の配当                |         |         |          |         |        |          |         | △49,567 | △49,567 | △49,567   |
| 中間純利益                 |         |         |          |         |        |          |         | 75,728  | 75,728  | 75,728    |
| 土地再評価差額金の取崩           |         |         |          |         |        |          |         | △1,813  | △1,813  | △1,813    |
| 株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額） |         |         |          |         |        |          |         |         |         |           |
| 当中間期変動額合計             | -       | -       | -        | -       | -      | -        | -       | 24,348  | 24,348  | 24,348    |
| 当中間期末残高               | 324,279 | 250,619 | 171,464  | 422,083 | 73,714 | 710      | 138,495 | 755,272 | 968,191 | 1,714,554 |

（単位：百万円）

|                       | 評価・換算差額等     |         |          |            | 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 | 評価・換算差額等合計 |           |
| 当期首残高                 | 614,205      | △67,592 | △3,305   | 543,306    | 2,233,512 |
| 当中間期変動額               |              |         |          |            |           |
| 剰余金の配当                |              |         |          |            | △49,567   |
| 中間純利益                 |              |         |          |            | 75,728    |
| 土地再評価差額金の取崩           |              |         |          |            | △1,813    |
| 株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額） | △21,894      | 9,817   | 1,813    | △10,263    | △10,263   |
| 当中間期変動額合計             | △21,894      | 9,817   | 1,813    | △10,263    | 14,084    |
| 当中間期末残高               | 592,310      | △57,774 | △1,492   | 533,042    | 2,247,597 |

平成29年度中間期（平成29年4月1日から平成29年9月30日まで）

（単位：百万円）

|                       | 株主資本    |         |          |         |        |          |         |         |           | 株主資本合計    |
|-----------------------|---------|---------|----------|---------|--------|----------|---------|---------|-----------|-----------|
|                       | 資本金     | 資本剰余金   |          |         | 利益準備金  | 利益剰余金    |         |         | 利益剰余金合計   |           |
|                       |         | 資本準備金   | その他資本剰余金 | 資本剰余金合計 |        | その他利益剰余金 |         |         |           |           |
|                       |         |         |          |         |        | 退職慰労基金   | 別途積立金   | 繰越利益剰余金 |           |           |
| 当期首残高                 | 324,279 | 250,619 | 171,464  | 422,083 | 73,714 | 710      | 138,495 | 765,059 | 977,978   | 1,724,341 |
| 当中間期変動額               |         |         |          |         |        |          |         |         |           |           |
| 新株の発行                 |         |         | 3,181    | 3,181   |        |          |         |         |           | 3,181     |
| 剰余金の配当                |         |         |          |         |        |          |         | △62,484 | △62,484   | △62,484   |
| 中間純利益                 |         |         |          |         |        |          |         | 126,096 | 126,096   | 126,096   |
| 土地再評価差額金の取崩           |         |         |          |         |        |          |         | △904    | △904      | △904      |
| 株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額） |         |         |          |         |        |          |         |         |           |           |
| 当中間期変動額合計             | -       | -       | 3,181    | 3,181   | -      | -        | -       | 62,708  | 62,708    | 65,889    |
| 当中間期末残高               | 324,279 | 250,619 | 174,646  | 425,265 | 73,714 | 710      | 138,495 | 827,767 | 1,040,686 | 1,790,231 |

（単位：百万円）

|                       | 評価・換算差額等     |         |          |            | 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 | 評価・換算差額等合計 |           |
| 当期首残高                 | 529,191      | △344    | △1,493   | 527,353    | 2,251,695 |
| 当中間期変動額               |              |         |          |            |           |
| 新株の発行                 |              |         |          |            | 3,181     |
| 剰余金の配当                |              |         |          |            | △62,484   |
| 中間純利益                 |              |         |          |            | 126,096   |
| 土地再評価差額金の取崩           |              |         |          |            | △904      |
| 株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額） | 57,174       | △9,612  | 904      | 48,466     | 48,466    |
| 当中間期変動額合計             | 57,174       | △9,612  | 904      | 48,466     | 114,356   |
| 当中間期末残高               | 586,366      | △9,957  | △589     | 575,820    | 2,366,051 |

## 注記事項（平成29年度中間期）

### （重要な会計方針）

#### 1. 特定取引資産・負債の評価基準及び収益・費用の計上基準

金利、通貨の価格、金融商品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、中間貸借対照表上「特定取引資産」及び「特定取引負債」に計上するとともに、当該取引からの損益（利息、売却損益及び評価損益）を中間損益計算書上「特定取引収益」及び「特定取引費用」に計上しております。

特定取引資産及び特定取引負債の評価は、時価法により行っております。

#### 2. 有価証券の評価基準及び評価方法

(1) 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）、子会社株式及び関連会社株式については移動平均法による原価法、その他有価証券については原則として中間決算日の市場価格等に基づく時価法（売却原価は移動平均法により算定）、ただし時価を把握することが極めて困難と認められるものについては移動平均法による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、時価ヘッジの適用により損益に反映させた額を除き、全部純資産直入法により処理しております。

(2) 有価証券運用を主目的とする単独運用の金銭の信託の信託財産の構成物である有価証券の評価は、時価法により行っております。

なお、運用目的及び満期保有目的以外の金銭の信託の信託財産の構成物である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。

#### 3. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法

デリバティブ取引（特定取引目的の取引を除く）の評価は、原則として時価法により行っております。

#### 4. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産（リース資産を除く）

有形固定資産は、定率法により償却し、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。

また、主な耐用年数は次のとおりであります。

|     |         |
|-----|---------|
| 建物  | 15年～50年 |
| その他 | 4年～15年  |

(2) 無形固定資産（リース資産を除く）

無形固定資産は、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社内における利用可能期間（主として5年）にわたって、のれんについてはその効果の及び期間にわたって償却しております。

(3) リース資産

所有権移転外ファイナンス・リース取引に係る「有形固定資産」中のリース資産は、リース期間を耐用年数とした定額法により償却しております。なお、残存価額については、リース契約上に残価保証の取決めがあるものは当該残価保証額とし、それ以外のものは零としております。

#### 5. 引当金の計上基準

(1) 貸倒引当金

貸倒引当金は、予め定めている資産の自己査定基準及び償却・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、手形交換所における取引停止処分等、法的・形式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。）に対する債権及び実質的に経営破綻に陥っている債務者（以下、「実質破綻先」という。）に対する債権については、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が可能と認められる額を控除し、その残額を計上しております。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。）に対する債権のうち、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ることができない債権については、債権額から担保の処分可能見込額及び保証による回収が可能と認められる額を控除し、その残額のうち、債務者の支払能力を総合的に判断して必要と認められる額を計上しております。破綻懸念先及び今後の管理に注意を要する債務者に対する債権のうち、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・フローを当初の約定利率で割り引いた金額と債権の帳簿価額との差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等から算出した貸倒引当率を債権額に乘じた額を計上しております。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じる損失見込額を特定海外債権引当額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、営業部及び審査所が資産査定を実施し、当該部署から独立した資産監査部署が査定結果を監査しております。

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5,801百万円であります。

(2) 賞与引当金

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、当中間会計期間に帰属する額を計上しております。

(3) 役員賞与引当金

役員賞与引当金は、役員への賞与の支払いに備えるため、役員に対する賞与の支給見込額のうち、当中間会計期間に帰属する額を計上しております。

(4) 株式給付引当金

株式給付引当金は、取締役等への株式報酬制度における報酬支払いに備えるため、取締役等に対する報酬の支給見込額のうち、当中間会計期間末までに発生していると認められる額を計上しております。

(5) 退職給付引当金

退職給付引当金は、従業員の退職給付に備えるため、当事業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。ただし、年金資産の額が退職給付債務に未認識過去勤務費用及び未認識数理計算上の差異を加減した額を超過している場合は、「前払年金費用」に計上しております。また、退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当中間会計期間末までの期間に帰属させる方法については給付算定式基準によっております。なお、過去勤務費用及び数理計算上の差異の費用処理方法は次のとおりであります。

過去勤務費用： 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（10～15年）による定額法により費用処理

数理計算上の差異： 各事業年度の発生時における従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（10～15年）による定額法により按分した額を、それぞれ発生時の翌事業年度から費用処理

(6) 偶発損失引当金

偶発損失引当金は、オフバランス取引や信託取引等に関して偶発的に発生する損失に備えるため、将来発生する可能性のある損失の見積額を計上しております。

#### 6. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

外貨建資産・負債及び海外支店勘定は、子会社株式及び関連会社株式を除き、中間決算日の為替相場による円換算額を付しております。なお、子会社株式及び関連会社株式は、主として取得時又は為替変動リスクに対するヘッジ取引実施時の為替相場による円換算額を付しております。

#### 7. ヘッジ会計の方法

(イ) 金利リスク・ヘッジ

金融資産・負債から生じる金利リスクを対象とするヘッジ会計のヘッジ対象を識別する方法は、業種別監査委員会報告第24号「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」（平成14年2月13日 日本公認会計士協会。以下、「業種別監査委員会報告第24号」という。）及び会計制度委員会報告第14号「金融商品会計に関する実務指針」（平成12年1月31日 日本公認会計士協会）に示されている取扱いによる包括ヘッジ又は個別ヘッジによっております。ヘッジ会計の方法は、金利スワップ等の特例処理の要件を満たす一部の取引は特例処理によっており、それ以外の場合には繰延ヘッジによっております。

固定金利の預金・貸出金等の相場変動を相殺するヘッジにおいては、個別に又は業種別監査委員会報告第24号に基づき一定の残存期間毎にグルーピングしてヘッジ対象を識別し、金利スワップ取引等をヘッジ手段として指定しております。その他有価証券に区分している固定金利の債券の相場変動を相殺するヘッジにおいては、同一種類毎にヘッジ対象を識別し、金利スワップ取引等をヘッジ手段として指定しております。ヘッジ対象とヘッジ手段に関する重要な条件がほぼ同一となるようなヘッジ指定を行っているため、高い有効性があるとみなしており、これをもって有効性の判定に代えております。

変動金利の預金・貸出金等及び短期固定金利の預金・貸出金等に係る予定取引のキャッシュ・フローを固定するヘッジにおいては、業種別監査委員会報告第24号に基づき金利インデックス及び一定の金利改定期間毎にグルーピングしてヘッジ対象を識別し、金利スワップ取引等をヘッジ手段として指定しております。ヘッジ対象とヘッジ手段に関する重要な条件がほぼ同一となるようなヘッジ指定を行っているため、高い有効性があるとみなしており、これをもって有効性の判定に代えているほか、金利変動要素の相関関係の検証により有効性の評価を行っております。

(ロ) 為替変動リスク・ヘッジ

外貨建の金融資産・負債から生じる為替変動リスクに対するヘッジ会計については、業種別監査委員会報告第25号「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」（平成14年7月29日 日本公認会計士協会。以下、「業種別監査委員会報告第25号」という。）に基づき、外貨建金銭債権債務等を通貨毎にグルーピングしてヘッジ対象を識別し、同一通貨の通貨スワップ取引及び為替予約（資金関連スワップ取引）をヘッジ手段として指定しており、ヘッジ会計の方法は、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、外貨建その他有価証券（債券以外）の為替変動リスクをヘッジするため、同一通貨の外貨建金銭債務及び為替予約をヘッジ手段として包括ヘッジを行っており、時価ヘッジを適用しております。

(ハ) 株価変動リスク・ヘッジ

その他有価証券のうち、政策投資目的で保有する株式の相場変動リスクをヘッジするため、トータル・リターン・スワップをヘッジ手段として個別ヘッジを行っており、ヘッジの有効性評価については、ヘッジ対象の時価変動等とヘッジ手段の時価変動等との相関関係を検証する方法により行っております。ヘッジ会計の方法は、時価ヘッジによっております。

(ニ) 内部取引等

デリバティブ取引のうち特定取引勘定とそれ以外の勘定との間（又は内部部門間）の内部取引については、ヘッジ手段として指定している金利スワップ取引及び通貨スワップ取引等に対して、業種別監査委員会報告第24号及び同第25号に基づき、恣意性を排除し厳格なヘッジ運営が可能と認められる対外力バー取引の基準に準拠した運営を行っているため、当該金利スワップ取引及び通貨スワップ取引等から生じる損益又は評価差額を消去せずに当中間会計期間の損益として処理し、あるいは繰延処理を行っております。

## 8. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項

## (1) 退職給付に係る会計処理

退職給付に係る未認識数理計算上の差異及び未認識過去勤務費用の会計処理の方法は、中間連結財務諸表におけるこれらの会計処理の方法と異なっております。

## (2) 消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税(以下、「消費税等」という。)の会計処理は、税抜方式によっております。

なお、資産に係る控除対象外消費税等は発生した事業年度の費用に計上しております。

## (3) 連結納税制度の適用

当社は、株式会社三菱UFJフィナンシャル・グループを連結納税親会社とする連結納税制度を適用しております。

## (4) 手形割引及び再割引の会計処理

手形割引及び再割引は、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。

## (追加情報)

グループの「機能別再編」の一環として、三菱UFJ証券ホールディングス株式会社及び株式会社三菱東京UFJ銀行が保有する三菱UFJ国際投信株式会社の持分を譲り受け、平成30年4月1日を予定日として同社を完全子会社化する方針を、平成29年5月15日開催の当社の取締役会で見議いたしました。なお、具体的な方法等については検討中であり、現時点で影響額を見積ることは出来ません。

## (中間貸借対照表関係)

## 1. 関係会社の株式及び出資金総額

株式及び出資金 226,129百万円

## 2. 消費貸借契約により借り入れている有価証券及び現先取引により受け入れている有価証券のうち、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は次のとおりであります。

再担保に差し入れている有価証券 1,174,365百万円

当中間会計期間末に当該処分をせずに所有している有価証券

22,135百万円

手形割引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、その額面金額は次のとおりであります。

821百万円

## 3. 貸出金のうち、破綻先債権額及び延滞債権額は次のとおりであります。

破綻先債権額 475百万円

延滞債権額 11,922百万円

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。

## 4. 貸出金のうち、3ヵ月以上延滞債権額は次のとおりであります。

3ヵ月以上延滞債権額 86百万円

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ヵ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。

## 5. 貸出金のうち、貸出条件緩和債権額は次のとおりであります。

貸出条件緩和債権額 30,630百万円

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。

## 6. 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次のとおりであります。

合計額 43,114百万円

なお、上記3. から6. に掲げた債権額は、貸倒引当金控除前の金額であります。

## 7. 担保に供している資産は次のとおりであります。

現金預け金 5,071百万円

有価証券 806,423百万円

貸出金 2,423,783百万円

担保資産に対応する債務

預金 42,600百万円

借入金 2,543,133百万円

支払承諾 11,495百万円

上記のほか、為替決済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、次のものを差し入れております。

有価証券 1,541,788百万円

貸出金 291,779百万円

また、売現先取引による買戻し条件付の売却又は現金担保付債券貸借取引による貸出を行っている資産は次のとおりであります。

有価証券 5,265,766百万円

対応する債務

売現先勘定 4,859,868百万円

債券貸借取引受入担保金 399,908百万円

8. 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し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次のとおりであります。

融資未実行残高 8,217,073百万円

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。

9. 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が含まれております。

劣後特約付借入金 392,000百万円

10. 社債には、劣後特約付社債が含まれております。

劣後特約付社債 240,000百万円

11. 有価証券中の社債のうち、有価証券の私募(金融商品取引法第2条第3項)による社債に対する当社の保証債務の額

28,520百万円

12. 元本補てん契約のある信託の元本金額は、次のとおりであります。

金銭信託 6,521,892百万円

13. 当社の子会社であるMUFG Alternative Fund Services (Cayman) Limited (以下、「当該子会社」という。)に適用される現地の金融規制である大口信用供与規制に関して、ケイマン諸島金融管理局の要請により保証が求められていることから、当該子会社に対して上限250百万米ドル(28,175百万円)を保証する念書を差し入れております。

14. 海外子会社による顧客との取引に関連して、親会社として当該子会社の事業を健全に管理し、当該子会社が負う金融債務を確実に履行できるよう経営監督すること等を約した経営指導念書を、海外金融当局等へ4件差し入れております。

## (中間損益計算書関係)

1. その他経常収益には、次のものを含んでおります。

株式等売却益 13,660百万円

貸倒引当金戻入益 13,035百万円

2. その他経常費用には、次のものを含んでおります。

偶発損失引当金繰入 14,314百万円

3. 特別利益は、次のとおりであります。

関連会社株式交換益 52,811百万円

固定資産処分益 439百万円

「関連会社株式交換益」は、当社の関連会社であったAberdeen Asset Management PLCが、平成29年8月14日付でStandard Life plcと株式交換による経営統合を行ったことに伴い発生した交換益であります。

4. 特別損失は、次のとおりであります。

減損損失 3,358百万円

固定資産処分損 867百万円

## (重要な後発事象)

当社と株式会社三菱東京UFJ銀行(以下、「商業銀行」という。)は、関係当局の認可を前提として、平成30年4月16日を効力発生日とした、当社の国内本支店において記帳されている法人貸出等業務を商業銀行が承継する吸収分割契約、及び当社の海外拠点(ニューヨーク、ロンドン、香港及びシンガポール)において記帳されている法人貸出等業務を商業銀行が譲り受ける事業譲渡契約を平成29年10月31日付で締結いたしました。(以下、本吸収分割契約に基づく吸収分割と本事業譲渡契約に基づく事業譲渡は「本件組織再編」という。)

## 本件組織再編の目的

MUFGグループでは、シンプル・スピーディー・トランスパレントなグループ体を経営を通じ、顧客・役職員・株主その他のステイクホルダーに最善の価値を提供すること、及び課題解決型のビジネスを展開することで、持続的な成長とより良い社会の実現に貢献すること等を目的とした「MUFG再創造イニシアティブ」を公表いたしました。

その一環として、本件組織再編により、法人のお客様にグループ一体で対応する体制の構築、及びグループ各社の使命と機能分担をより明確化します(グループの「機能別再編」)。

なお、当社の貸出金の貸借対照表計上額(当中間会計期間末14兆3,076億円)の大部分を承継及び譲渡する予定ですが、貸借対照表への影響額は、本件組織再編の効力発生日が平成30年4月16日であるため、現時点においては未確定であります。

## 有価証券関係

### 平成28年度中間期

※中間貸借対照表の「有価証券」のほか、「買入金銭債権」中の有価証券及び有価証券に準ずるものを含めて記載しております。

#### 1. 満期保有目的の債券

該当事項はありません。

#### 2. 子会社株式及び関連会社株式

(単位：百万円)

|        | 平成28年度中間期末 |         |        |
|--------|------------|---------|--------|
|        | 中間貸借対照表計上額 | 時価      | 差額     |
| 子会社株式  | 11,055     | 10,895  | △160   |
| 関連会社株式 | 49,616     | 95,848  | 46,232 |
| 合計     | 60,671     | 106,743 | 46,072 |

(注) 時価を把握することが極めて困難と認められる子会社株式及び関連会社株式

(単位：百万円)

|        | 平成28年度中間期末 |
|--------|------------|
|        | 中間貸借対照表計上額 |
| 子会社株式  | 156,805    |
| 関連会社株式 | 64,495     |
| 合計     | 221,300    |

これらについては、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「子会社株式及び関連会社株式」には含めておりません。

#### 3. その他有価証券

(単位：百万円)

|                        |            | 平成28年度中間期末 |            |         |
|------------------------|------------|------------|------------|---------|
|                        |            | 中間貸借対照表計上額 | 取得原価       | 差額      |
| 中間貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの  | 株式         | 842,640    | 394,853    | 447,787 |
|                        | 債券         | 6,378,745  | 6,283,343  | 95,402  |
|                        | 国債         | 5,809,710  | 5,722,194  | 87,515  |
|                        | 地方債        | 38,854     | 38,290     | 563     |
|                        | 社債         | 530,181    | 522,858    | 7,323   |
|                        | その他        | 7,676,221  | 7,350,450  | 325,770 |
|                        | 外国株式       | 53         | 21         | 31      |
|                        | 外国債券       | 6,892,639  | 6,640,328  | 252,310 |
|                        | その他        | 783,528    | 710,100    | 73,428  |
|                        | 小計         | 14,897,608 | 14,028,647 | 868,960 |
| 中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの | 株式         | 81,510     | 97,277     | △15,766 |
|                        | 債券         | 41,914     | 43,478     | △1,563  |
|                        | 国債         | —          | —          | —       |
|                        | 地方債        | 1,051      | 1,052      | △0      |
|                        | 社債         | 40,863     | 42,425     | △1,562  |
|                        | その他        | 940,991    | 948,556    | △7,565  |
|                        | 外国株式       | 1          | 1          | —       |
|                        | 外国債券       | 764,694    | 768,241    | △3,546  |
|                        | その他        | 176,295    | 180,314    | △4,019  |
|                        | 小計         | 1,064,416  | 1,089,312  | △24,895 |
| 合計                     | 15,962,024 | 15,117,960 | 844,064    |         |

(注) 1. 上記の差額には、時価ヘッジの適用により、損益に反映させた額627百万円(収益)が含まれております。

2. 時価を把握することが極めて困難と認められるその他有価証券 (単位：百万円)

|      | 平成28年度中間期末 |
|------|------------|
|      | 中間貸借対照表計上額 |
| 株式   | 21,411     |
| その他  | 7,875      |
| 外国株式 | 569        |
| その他  | 7,305      |
| 合計   | 29,286     |

これらについては、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

#### 4. 減損処理を行った有価証券

売買目的有価証券以外の有価証券(時価を把握することが極めて困難なものを除く)のうち、当該有価証券の時価が取得原価に比べて著しく下落しており、時価が取得原価まで回復する見込みがあると認められないものについては、当該時価をもって中間貸借対照表計上額とするとともに、評価差額を当中間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。

当中間会計期間における減損処理額は、時価を把握することが極めて困難と認められるものも含め、899百万円(うち、株式719百万円、その他179百万円)であります。

また、時価が「著しく下落した」と判断するための基準は、予め定めている資産の自己査定基準に有価証券の発行会社の区分毎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50%以上下落

なお、破綻先とは、破産、特別清算、手形交換所における取引停止処分等、法的・形式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、実質的に経営破綻に陥っている発行会社、破綻懸念先とは、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であります。要注意先とは、今後の管理に注意を要する発行会社であります。正常先とは、上記破綻先、実質破綻先、破綻懸念先及び要注意先以外の発行会社であります。

## 平成29年度中間期

※中間貸借対照表の「有価証券」のほか、「買入金銭債権」中の有価証券及び有価証券に準ずるものを含めて記載しております。

### 1. 満期保有目的の債券

(単位：百万円)

|                      |       | 平成29年度中間期末 |       |     |
|----------------------|-------|------------|-------|-----|
|                      |       | 中間貸借対照表計上額 | 時価    | 差額  |
| 時価が中間貸借対照表計上額を超えるもの  | 国債    | —          | —     | —   |
|                      | 地方債   | —          | —     | —   |
|                      | 社債    | —          | —     | —   |
|                      | その他   | 3,710      | 3,814 | 103 |
|                      | 小計    | 3,710      | 3,814 | 103 |
| 時価が中間貸借対照表計上額を超えないもの | 国債    | —          | —     | —   |
|                      | 地方債   | —          | —     | —   |
|                      | 社債    | —          | —     | —   |
|                      | その他   | —          | —     | —   |
|                      | 小計    | —          | —     | —   |
| 合計                   | 3,710 | 3,814      | 103   |     |

### 2. 子会社株式及び関連会社株式

(単位：百万円)

|        |       | 平成29年度中間期末 |     |    |
|--------|-------|------------|-----|----|
|        |       | 中間貸借対照表計上額 | 時価  | 差額 |
| 子会社株式  | 6,722 | 6,958      | 235 |    |
| 関連会社株式 | —     | —          | —   |    |
| 合計     | 6,722 | 6,958      | 235 |    |

(注) 時価を把握することが極めて困難と認められる子会社株式及び関連会社株式

(単位：百万円)

|        | 平成29年度中間期末 |    |
|--------|------------|----|
|        | 中間貸借対照表計上額 | 時価 |
| 子会社株式  | 175,848    | —  |
| 関連会社株式 | 43,558     | —  |
| 合計     | 219,406    | —  |

これらについては、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「子会社株式及び関連会社株式」には含めておりません。

### 3. その他有価証券

(単位：百万円)

|                       |                        | 平成29年度中間期末 |            |         |
|-----------------------|------------------------|------------|------------|---------|
|                       |                        | 中間貸借対照表計上額 | 取得原価       | 差額      |
| 中間貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの | 株式                     | 1,072,426  | 441,099    | 631,326 |
|                       | 債券                     | 3,192,388  | 3,156,858  | 35,530  |
|                       | 国債                     | 3,023,432  | 2,989,859  | 33,572  |
|                       | 地方債                    | 68         | 64         | 4       |
|                       | 社債                     | 168,887    | 166,934    | 1,953   |
|                       | その他                    | 6,138,012  | 5,883,397  | 254,615 |
|                       | 外国株式                   | 111,463    | 102,453    | 9,010   |
|                       | 外国債券                   | 5,076,673  | 4,971,685  | 104,988 |
|                       | その他                    | 949,876    | 809,258    | 140,617 |
|                       | 小計                     | 10,402,827 | 9,481,354  | 921,472 |
|                       | 中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの | 株式         | 26,105     | 28,773  |
| 債券                    |                        | 700,762    | 703,369    | △2,607  |
| 国債                    |                        | 637,826    | 639,795    | △1,969  |
| 社債                    |                        | 62,935     | 63,573     | △638    |
| その他                   |                        | 3,372,981  | 3,449,339  | △76,357 |
| 外国株式                  |                        | 1          | 1          | —       |
| 外国債券                  |                        | 2,868,770  | 2,900,725  | △31,954 |
| その他                   |                        | 504,209    | 548,612    | △44,403 |
| 小計                    |                        | 4,099,849  | 4,181,482  | △81,633 |
| 合計                    |                        | 14,502,676 | 13,662,837 | 839,839 |

(注) 1. 上記の差額には、時価ヘッジの適用により、損益に反映させた額3,979百万円(収益)が含まれております。

2. 時価を把握することが極めて困難と認められるその他有価証券 (単位：百万円)

|      | 平成29年度中間期末 |    |
|------|------------|----|
|      | 中間貸借対照表計上額 | 時価 |
| 株式   | 20,976     | —  |
| その他  | 25,556     | —  |
| 外国株式 | 15,815     | —  |
| その他  | 9,740      | —  |
| 合計   | 46,533     | —  |

これらについては、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

### 4. 減損処理を行った有価証券

売買目的有価証券以外の有価証券(時価を把握することが極めて困難なものを除く)のうち、当該有価証券の時価が取得原価に比べて著しく下落しており、時価が取得原価まで回復する見込みがあると認められないものについては、当該時価をもって中間貸借対照表計上額とするとともに、評価差額を当中間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。

当中間会計期間における減損処理額は、時価を把握することが極めて困難と認められるものも含め、214百万円(うち、株式92百万円、その他122百万円)であります。

また、時価が「著しく下落した」と判断するための基準は、予め定めている資産の自己査定基準に有価証券の発行会社の区分毎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50%以上下落  
 なお、破綻先とは、破産、特別清算、手形交換所における取引停止処分等、法的・形式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、実質的に経営破綻に陥っている発行会社、破綻懸念先とは、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であります。要注意先とは、今後の管理に注意を要する発行会社であります。正常先とは、上記破綻先、実質破綻先、破綻懸念先及び要注意先以外の発行会社であります。

## 金銭の信託関係

### 1. 満期保有目的の金銭の信託（平成28年度中間期末、平成29年度中間期末）

該当事項はありません。

### 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）

|           | 平成28年度中間期末 |      |    |                         |                          | 平成29年度中間期末 |        |        |                         |                          |
|-----------|------------|------|----|-------------------------|--------------------------|------------|--------|--------|-------------------------|--------------------------|
|           | 中間貸借対照表計上額 | 取得原価 | 差額 | うち中間貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの |                          | 中間貸借対照表計上額 | 取得原価   | 差額     | うち中間貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの |                          |
|           |            |      |    | うち中間貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの | うち中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの |            |        |        | うち中間貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの | うち中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの |
| その他の金銭の信託 | —          | —    | —  | —                       | —                        | 37,665     | 40,000 | △2,334 | —                       | 2,334                    |

（注）「うち中間貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの」「うち中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの」はそれぞれ「差額」の内訳であります。

## その他有価証券評価差額金

中間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）

|                  | 平成28年度中間期末 | 平成29年度中間期末 |
|------------------|------------|------------|
| 評価差額             |            |            |
| その他有価証券          | 843,441    | 831,848    |
| その他の金銭の信託        | —          | △2,334     |
| 繰延税金資産（△は繰延税金負債） | △251,131   | △243,147   |
| その他有価証券評価差額金     | 592,310    | 586,366    |

- （注）1. 評価差額からは、時価ヘッジの適用により損益に反映させた額（平成28年度中間期末627百万円（収益）、平成29年度中間期末3,979百万円（収益））を除いております。  
 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（平成28年度中間期末4百万円（益）、平成29年度中間期末31百万円（益））及び時価を把握することが極めて困難と認められる外貨建その他有価証券に係る為替換算差額（平成28年度中間期末－百万円、平成29年度中間期末4,042百万円（損））を含めております。



## デリバティブ取引関係

平成28年度中間期

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

### (1) 金利関連取引 (単位：百万円)

|           | 契約額等      |           | 時価      | 評価損益    |
|-----------|-----------|-----------|---------|---------|
|           |           | うち1年超     |         |         |
| 金融商品取引所   |           |           |         |         |
| 金利先物      |           |           |         |         |
| 売建        | —         | —         | —       | —       |
| 買建        | —         | —         | —       | —       |
| 金利オプション   |           |           |         |         |
| 売建        | —         | —         | —       | —       |
| 買建        | —         | —         | —       | —       |
| 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 | 4,284,831 | 3,849,612 | 96,520  | 96,520  |
| 受取変動・支払固定 | 4,310,840 | 3,855,058 | △76,054 | △76,054 |
| 受取変動・支払変動 | 228,957   | 228,957   | △11     | △11     |
| 受取固定・支払固定 | 5,021     | 5,021     | 496     | 496     |
| 金利オプション   |           |           |         |         |
| 売建        | —         | —         | —       | —       |
| 買建        | —         | —         | —       | —       |
| キャップ・フロアー |           |           |         |         |
| 売建        | 19,775    | 19,500    | △193    | △193    |
| 買建        | 19,757    | 19,500    | △95     | △121    |
| 金利スワップション |           |           |         |         |
| 売建        | —         | —         | —       | —       |
| 買建        | —         | —         | —       | —       |
| その他       |           |           |         |         |
| 売建        | —         | —         | —       | —       |
| 買建        | —         | —         | —       | —       |
| 合計        |           |           | 20,660  | 20,635  |

(注) 1. 上記取引については時価評価を行い、評価損益を中間損益計算書に計上しております。  
2. 時価の算定 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：百万円)

|         | 契約額等       |         | 時価      | 評価損益    |
|---------|------------|---------|---------|---------|
|         |            | うち1年超   |         |         |
| 金融商品取引所 |            |         |         |         |
| 通貨先物    |            |         |         |         |
| 売建      | —          | —       | —       | —       |
| 買建      | —          | —       | —       | —       |
| 通貨オプション |            |         |         |         |
| 売建      | —          | —       | —       | —       |
| 買建      | —          | —       | —       | —       |
| 店頭      |            |         |         |         |
| 通貨スワップ  | 845,530    | 770,336 | 3,096   | 3,096   |
| 為替予約    |            |         |         |         |
| 売建      | 10,393,476 | 123,201 | 79,639  | 79,639  |
| 買建      | 10,520,181 | 119,944 | △92,147 | △92,147 |
| 通貨オプション |            |         |         |         |
| 売建      | 224,381    | 42,415  | △5,140  | 449     |
| 買建      | 210,682    | 32,550  | 5,363   | △815    |
| その他     |            |         |         |         |
| 売建      | —          | —       | —       | —       |
| 買建      | —          | —       | —       | —       |
| 合計      |            |         | △9,188  | △9,776  |

(注) 1. 上記取引については時価評価を行い、評価損益を中間損益計算書に計上しております。  
2. 時価の算定 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) 株式関連取引

該当事項はありません。

### (4) 債券関連取引 (単位：百万円)

|           | 契約額等 |       | 時価 | 評価損益 |
|-----------|------|-------|----|------|
|           |      | うち1年超 |    |      |
| 金融商品取引所   |      |       |    |      |
| 債券先物      |      |       |    |      |
| 売建        | 761  | —     | △0 | △0   |
| 買建        | —    | —     | —  | —    |
| 債券先物オプション |      |       |    |      |
| 売建        | —    | —     | —  | —    |
| 買建        | —    | —     | —  | —    |
| 店頭        |      |       |    |      |
| 債券店頭オプション |      |       |    |      |
| 売建        | —    | —     | —  | —    |
| 買建        | —    | —     | —  | —    |
| その他       |      |       |    |      |
| 売建        | —    | —     | —  | —    |
| 買建        | —    | —     | —  | —    |
| 合計        |      |       | △0 | △0   |

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

該当事項はありません。

### (6) クレジット・デリバティブ取引

該当事項はありません。

平成29年度中間期

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1) 金利関連取引

(単位：百万円)

|           | 契約額等      |           | 時価      | 評価損益    |
|-----------|-----------|-----------|---------|---------|
|           |           | うち1年超     |         |         |
| 金融商品取引所   |           |           |         |         |
| 金利先物      |           |           |         |         |
| 売建        | -         | -         | -       | -       |
| 買建        | -         | -         | -       | -       |
| 金利オプション   |           |           |         |         |
| 売建        | -         | -         | -       | -       |
| 買建        | -         | -         | -       | -       |
| 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 | 4,088,655 | 3,713,770 | 44,883  | 44,883  |
| 受取変動・支払固定 | 4,121,233 | 3,700,564 | △27,033 | △27,033 |
| 受取変動・支払変動 | 265,294   | 265,294   | △16     | △16     |
| 受取固定・支払固定 | 5,254     | 5,254     | 421     | 421     |
| 金利オプション   |           |           |         |         |
| 売建        | -         | -         | -       | -       |
| 買建        | -         | -         | -       | -       |
| キャップ・フロアー |           |           |         |         |
| 売建        | 19,500    | 19,500    | △117    | 606     |
| 買建        | 25,222    | 25,222    | △92     | △453    |
| 金利スワップション |           |           |         |         |
| 売建        | -         | -         | -       | -       |
| 買建        | -         | -         | -       | -       |
| その他       |           |           |         |         |
| 売建        | -         | -         | -       | -       |
| 買建        | -         | -         | -       | -       |
| 合計        |           |           | 18,045  | 18,408  |

(注) 1. 上記取引については時価評価を行い、評価損益を中間損益計算書に計上しております。  
2. 時価の算定 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：百万円)

|         | 契約額等       |         | 時価       | 評価損益     |
|---------|------------|---------|----------|----------|
|         |            | うち1年超   |          |          |
| 金融商品取引所 |            |         |          |          |
| 通貨先物    |            |         |          |          |
| 売建      | -          | -       | -        | -        |
| 買建      | -          | -       | -        | -        |
| 通貨オプション |            |         |          |          |
| 売建      | -          | -       | -        | -        |
| 買建      | -          | -       | -        | -        |
| 店頭      |            |         |          |          |
| 通貨スワップ  | 864,986    | 696,222 | 1,621    | 1,621    |
| 為替予約    |            |         |          |          |
| 売建      | 13,164,968 | 111,832 | △220,056 | △220,056 |
| 買建      | 13,572,936 | 113,852 | 213,385  | 213,385  |
| 通貨オプション |            |         |          |          |
| 売建      | 235,404    | 42,877  | △3,733   | 896      |
| 買建      | 227,654    | 41,059  | 3,814    | △1,373   |
| その他     |            |         |          |          |
| 売建      | -          | -       | -        | -        |
| 買建      | -          | -       | -        | -        |
| 合計      |            |         | △4,969   | △5,527   |

(注) 1. 上記取引については時価評価を行い、評価損益を中間損益計算書に計上しております。  
2. 時価の算定 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) 株式関連取引

(単位：百万円)

|           | 契約額等    |       | 時価  | 評価損益 |
|-----------|---------|-------|-----|------|
|           |         | うち1年超 |     |      |
| 金融商品取引所   |         |       |     |      |
| 株式指数先物    |         |       |     |      |
| 売建        | -       | -     | -   | -    |
| 買建        | -       | -     | -   | -    |
| 株式指数オプション |         |       |     |      |
| 売建        | -       | -     | -   | -    |
| 買建        | 100,008 | -     | 837 | △78  |
| 合計        |         |       | 837 | △78  |

(注) 1. 上記取引については時価評価を行い、評価損益を中間損益計算書に計上しております。  
2. 時価の算定 大阪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：百万円)

|           | 契約額等    |       | 時価  | 評価損益 |
|-----------|---------|-------|-----|------|
|           |         | うち1年超 |     |      |
| 金融商品取引所   |         |       |     |      |
| 債券先物      |         |       |     |      |
| 売建        | -       | -     | -   | -    |
| 買建        | -       | -     | -   | -    |
| 債券先物オプション |         |       |     |      |
| 売建        | -       | -     | -   | -    |
| 買建        | 252,560 | -     | 316 | △188 |
| 店頭        |         |       |     |      |
| 債券店頭オプション |         |       |     |      |
| 売建        | -       | -     | -   | -    |
| 買建        | -       | -     | -   | -    |
| その他       |         |       |     |      |
| 売建        | -       | -     | -   | -    |
| 買建        | -       | -     | -   | -    |
| 合計        |         |       | 316 | △188 |

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

該当事項はありません。

(6) クレジット・デリバティブ取引

該当事項はありません。

## ● 営業の概況 (単体)

## 1. 部門別損益の内訳

(単位: 億円)

|   | 平成28年度中間期               | 平成29年度中間期               |
|---|-------------------------|-------------------------|
| <b>国内業務部門</b>                             |                         |                         |
| 信託報酬                                      | 498                     | 457                     |
| うち不良債権処理額                                 | 0                       | —                       |
| 資金利益                                      | 400                     | 464                     |
| 役務取引等利益                                   | 485                     | 500                     |
| 特定取引利益                                    | 45                      | △32                     |
| その他業務利益                                   | 33                      | △32                     |
| <b>業務粗利益</b>                              | <b>1,463</b><br>(1.20%) | <b>1,358</b><br>(1.25%) |
| <b>国際業務部門</b>                             |                         |                         |
| 資金利益                                      | 289                     | 447                     |
| 役務取引等利益                                   | 15                      | 31                      |
| 特定取引利益                                    | 26                      | 136                     |
| その他業務利益                                   | 128                     | 62                      |
| <b>業務粗利益</b>                              | <b>460</b><br>(0.72%)   | <b>678</b><br>(0.99%)   |
| <b>業務粗利益</b>                              | <b>1,923</b><br>(1.11%) | <b>2,036</b><br>(1.22%) |
| <b>経費 (除く臨時経費)</b>                        | <b>995</b>              | <b>993</b>              |
| 一般貸倒引当金繰入額                                | —                       | —                       |
| <b>業務純益</b><br>(信託勘定償却前業務純益 (一般貸倒引当金繰入前)) | <b>927</b><br>(927)     | <b>1,043</b><br>(1,043) |
| <b>臨時損益</b>                               | <b>127</b>              | <b>173</b>              |
| <b>経常利益</b>                               | <b>1,055</b>            | <b>1,216</b>            |

(注) 1. ( ) 内は業務粗利益率です。

2. 業務粗利益率 =  $\frac{\text{業務粗利益} / \text{期中日数} \times \text{年間日数}}{\text{資金運用勘定平均残高}} \times 100$ 

## 2. 資金利益の内訳

(単位: 億円)

|               | 平成28年度中間期      |            |              | 平成29年度中間期      |              |              |
|---------------|----------------|------------|--------------|----------------|--------------|--------------|
|               | 平均残高           | 利息         | 利回り          | 平均残高           | 利息           | 利回り          |
| <b>国内業務部門</b> |                | <b>400</b> | <b>0.32%</b> |                | <b>464</b>   | <b>0.42%</b> |
| <b>資金運用勘定</b> | <b>242,330</b> | <b>622</b> | <b>0.51</b>  | <b>216,172</b> | <b>591</b>   | <b>0.54</b>  |
| うち貸出金         | 95,047         | 250        | 0.52         | 101,840        | 236          | 0.46         |
| 有価証券          | 79,092         | 339        | 0.85         | 54,627         | 327          | 1.19         |
| 債券貸借取引支払保証金   | 572            | 0          | 0.00         | 7              | 0            | 0.01         |
| 預け金等          | 41,947         | 19         | 0.09         | 39,594         | 19           | 0.09         |
| <b>資金調達勘定</b> | <b>277,797</b> | <b>222</b> | <b>0.15</b>  | <b>277,124</b> | <b>126</b>   | <b>0.09</b>  |
| うち預金          | 119,438        | 66         | 0.11         | 128,853        | 54           | 0.08         |
| 譲渡性預金         | 22,197         | 2          | 0.01         | 25,798         | 0            | 0.00         |
| 債券貸借取引受入担保金   | 37,717         | 1          | 0.00         | 14,947         | 0            | 0.00         |
| 借入金等          | 34,387         | 8          | 0.05         | 39,871         | 8            | 0.04         |
| <b>国際業務部門</b> |                | <b>289</b> | <b>0.45</b>  |                | <b>447</b>   | <b>0.65</b>  |
| <b>資金運用勘定</b> | <b>127,315</b> | <b>676</b> | <b>1.05</b>  | <b>135,762</b> | <b>1,200</b> | <b>1.76</b>  |
| うち貸出金         | 36,772         | 209        | 1.13         | 40,791         | 342          | 1.67         |
| 有価証券          | 74,889         | 427        | 1.13         | 80,755         | 751          | 1.85         |
| 債券貸借取引支払保証金   | 2,386          | —          | —            | 1,182          | △1           | △0.27        |
| 預け金等          | 12,596         | 26         | 0.41         | 11,803         | 54           | 0.91         |
| <b>資金調達勘定</b> | <b>129,829</b> | <b>387</b> | <b>0.59</b>  | <b>137,843</b> | <b>752</b>   | <b>1.08</b>  |
| うち預金          | 18,520         | 47         | 0.51         | 22,729         | 102          | 0.89         |
| 譲渡性預金         | 19,920         | 64         | 0.64         | 22,657         | 105          | 0.92         |
| 債券貸借取引受入担保金   | —              | 2          | —            | —              | —            | —            |
| 借入金等          | 58,949         | 76         | 0.25         | 66,835         | 277          | 0.82         |
| <b>合計</b>     |                | <b>690</b> | <b>0.39</b>  |                | <b>912</b>   | <b>0.54</b>  |

(注) 1. 預け金等にはコールローンを含んでいます。

2. 借入金等にはコールマネー、売現先勘定及びコマースナル・ペーパーを含んでいます。

### 3. 資金利益の分析

(単位：億円)

|                 | 平成28年度中間期  |             |             | 平成29年度中間期  |            |            |
|-----------------|------------|-------------|-------------|------------|------------|------------|
|                 | 残高要因       | 利率要因        | 合計          | 残高要因       | 利率要因       | 合計         |
| <b>国内業務部門</b>   |            |             |             |            |            |            |
| <b>資金運用勘定</b>   | <b>50</b>  | <b>△104</b> | <b>△54</b>  | <b>△69</b> | <b>38</b>  | <b>△31</b> |
| うち貸出金           | 23         | △75         | △51         | 17         | △31        | △14        |
| 有価証券            | 12         | △11         | 0           | △123       | 110        | △12        |
| 債券貸借取引支払保証金     | 0          | —           | 0           | △0         | 0          | △0         |
| 預け金等            | 1          | △1          | 0           | △1         | 1          | 0          |
| <b>資金調達勘定</b>   | <b>47</b>  | <b>△5</b>   | <b>42</b>   | <b>△0</b>  | <b>△94</b> | <b>△95</b> |
| うち預金            | 6          | △20         | △14         | 4          | △17        | △12        |
| 譲渡性預金           | △2         | △8          | △11         | 0          | △1         | △1         |
| 債券貸借取引受入担保金     | 2          | △7          | △5          | △1         | —          | △1         |
| 借入金等            | 3          | △12         | △8          | 1          | △1         | △0         |
| <b>国内資金運用収支</b> | <b>2</b>   | <b>△99</b>  | <b>△96</b>  | <b>△69</b> | <b>133</b> | <b>64</b>  |
| <b>国際業務部門</b>   |            |             |             |            |            |            |
| <b>資金運用勘定</b>   | <b>△20</b> | <b>23</b>   | <b>3</b>    | <b>47</b>  | <b>476</b> | <b>523</b> |
| うち貸出金           | △7         | 67          | 59          | 24         | 108        | 133        |
| 有価証券            | △13        | △68         | △82         | 35         | 288        | 324        |
| 債券貸借取引支払保証金     | —          | —           | —           | —          | △1         | △1         |
| 預け金等            | △1         | 14          | 13          | △1         | 29         | 28         |
| <b>資金調達勘定</b>   | <b>△1</b>  | <b>176</b>  | <b>175</b>  | <b>25</b>  | <b>340</b> | <b>365</b> |
| うち預金            | △0         | 13          | 13          | 12         | 41         | 54         |
| 譲渡性預金           | △6         | 34          | 28          | 9          | 30         | 40         |
| 債券貸借取引受入担保金     | 2          | —           | 2           | —          | △2         | △2         |
| 借入金等            | △3         | 19          | 15          | 11         | 189        | 201        |
| <b>国際資金運用収支</b> | <b>△19</b> | <b>△152</b> | <b>△171</b> | <b>22</b>  | <b>135</b> | <b>158</b> |

(注) 1. 預け金等にはコールローンを含んでいます。  
2. 借入金等にはコールマネー、売現先勘定及びコマースナル・ペーパーを含んでいます。

### 4. 利鞘

(単位：%)

|         |           | 平成28年度中間期   | 平成29年度中間期   |
|---------|-----------|-------------|-------------|
| 資金運用利回り | 国内業務部門    | 0.51        | 0.54        |
|         | 国際業務部門    | 1.05        | 1.76        |
|         | <b>全店</b> | <b>0.74</b> | <b>1.06</b> |
| 資金調達利回り | 国内業務部門    | 0.15        | 0.09        |
|         | 国際業務部門    | 0.59        | 1.08        |
|         | <b>全店</b> | <b>0.31</b> | <b>0.43</b> |
| 資金粗利鞘   | 国内業務部門    | 0.35        | 0.45        |
|         | 国際業務部門    | 0.46        | 0.67        |
|         | <b>全店</b> | <b>0.43</b> | <b>0.63</b> |

## 5. 役務取引等利益の内訳

(単位：億円)

|        |            | 平成28年度中間期 | 平成29年度中間期 |
|--------|------------|-----------|-----------|
| 国内業務部門 | 役務取引等収益    | 609       | 646       |
|        | うち信託関連業務   | 335       | 334       |
|        | 預金・貸出業務    | 43        | 42        |
|        | 為替業務       | 4         | 4         |
|        | 証券関連業務     | 89        | 131       |
|        | 投資顧問業務     | 41        | 50        |
|        | 代理業務       | 0         | 0         |
|        | 保護預り・貸金庫業務 | 1         | 1         |
|        | 保証業務       | 1         | 1         |
|        | 役務取引等費用    | 124       | 145       |
| うち為替業務 | 2          | 2         |           |
|        | 役務取引等利益    | 485       | 500       |
| 国際業務部門 | 役務取引等収益    | 46        | 62        |
|        | うち預金・貸出業務  | 14        | 33        |
|        | 為替業務       | 0         | 0         |
|        | 保証業務       | 1         | 1         |
|        | 役務取引等費用    | 31        | 31        |
| うち為替業務 | 0          | 0         |           |
|        | 役務取引等利益    | 15        | 31        |
| 合計     |            | 500       | 532       |

## 6. 特定取引利益の内訳

(単位：億円)

|        |            | 平成28年度中間期 | 平成29年度中間期 |
|--------|------------|-----------|-----------|
| 国内業務部門 | うち商品有価証券   | 45        | △32       |
|        | 特定取引有価証券   | 0         | 0         |
|        | 特定金融派生商品   | △0        | △0        |
|        | その他の特定取引   | 45        | △33       |
|        |            | 0         | 0         |
| 国際業務部門 | うち特定取引有価証券 | 26        | 136       |
|        | 特定金融派生商品   | △0        | △0        |
|        |            | 26        | 136       |
| 合計     |            | 72        | 103       |

## 7. その他業務利益の内訳

(単位：億円)

|        |             | 平成28年度中間期 | 平成29年度中間期 |
|--------|-------------|-----------|-----------|
| 国内業務部門 | うち国債等債券関係損益 | 33        | △32       |
|        |             | 54        | 35        |
| 国際業務部門 | うち外国為替売買益   | 128       | 62        |
|        | 国債等債券関係損益   | 53        | 2         |
|        |             | 90        | 69        |
| 合計     |             | 161       | 30        |

## 8. 経費の内訳

(単位：億円)

|           | 平成28年度中間期 | 平成29年度中間期 |
|-----------|-----------|-----------|
| 人件費       | 385       | 364       |
| うち給料・手当   | 355       | 358       |
| 物件費       | 555       | 565       |
| うち減価償却費   | 120       | 128       |
| 土地建物機械賃借料 | 57        | 59        |
| 消耗品費      | 9         | 8         |
| 業務委託費     | 143       | 149       |
| 預金保険料     | 25        | 22        |
| 租税公課      | 55        | 63        |
| 合計        | 995       | 993       |

### 【特定取引|勘定について】

特定取引|勘定とは、金利、通貨の価格や金融商品市場の相場その他の指標に係る短期的な変動や市場間の格差等を利用して利益を得ること等を目的（以下、「特定取引目的」という。）とした取引を経理するために設けられた勘定のことです。

特定取引|には、具体的には金利スワップ等のデリバティブ取引、譲渡性預金等の金銭債権取引、国債等の有価証券関連取引などがあります。

特定取引目的の取引を行う部署は限定されており、その他の部署においては特定取引を行うことはできません。

特定取引|勘定はそれ以外の勘定と区別されており、原則として両勘定間の振替を行ってはならないこととしています。

特定取引|勘定で経理された取引には公正価値を付しており、その残高や損益が、貸借対照表や損益計算書等に計上されます。

公正価値の算定は、その公正性および客観性をより強固なものにする観点から、特定取引を行う部署から独立した部署で行うこととしています。

## ● 信託業務の状況（単体）

### 1. 信託財産残高表

（単位：百万円）

|              | 平成28年度中間期末<br>(平成28年9月30日) | 平成29年度中間期末<br>(平成29年9月30日) |
|--------------|----------------------------|----------------------------|
| <b>資産</b>    |                            |                            |
| 貸出金          | 172,918                    | 267,275                    |
| 有価証券         | 535,574                    | 496,052                    |
| 信託受益権        | 55,797,385                 | 64,527,627                 |
| 受託有価証券       | 13,761                     | 13,259                     |
| 金銭債権         | 7,597,485                  | 16,462,589                 |
| 有形固定資産       | 12,035,635                 | 13,022,417                 |
| 無形固定資産       | 206,638                    | 123,356                    |
| その他債権        | 178,724                    | 206,876                    |
| 銀行勘定貸        | 5,616,214                  | 6,576,576                  |
| 現金預け金        | 736,182                    | 791,497                    |
| <b>合計</b>    | <b>82,890,520</b>          | <b>102,487,529</b>         |
| <b>負債</b>    |                            |                            |
| 金銭信託         | 2,714,111                  | 3,039,126                  |
| 財産形成給付信託     | 7,523                      | 7,376                      |
| 投資信託         | 59,138,914                 | 68,783,725                 |
| 金銭信託以外の金銭の信託 | 645,509                    | 595,992                    |
| 有価証券の信託      | 13,839                     | 13,333                     |
| 金銭債権の信託      | 7,642,868                  | 16,385,054                 |
| 動産の信託        | 63,438                     | 67,131                     |
| 土地及びその定着物の信託 | 65,798                     | 43,968                     |
| 包括信託         | 12,598,515                 | 13,551,820                 |
| <b>合計</b>    | <b>82,890,520</b>          | <b>102,487,529</b>         |

- (注) 1. 上記残高表には、金銭評価の困難な信託および自己信託に係る分を除いています。なお、自己信託に係る信託財産残高は、平成28年度中間期末 一百万円、平成29年度中間期末 1,506百万円です。
2. 共同信託他社管理財産は次のとおりです。  
平成28年度中間期末 66,681,581百万円、平成29年度中間期末 68,553,267百万円
3. 元本補てん契約のある信託の貸出金 平成28年度中間期末（平成28年9月30日現在）20,489百万円のうち、破綻先債権額は3百万円、延滞債権額は0百万円、3カ月以上延滞債権額は5百万円、貸出条件緩和債権額は597百万円です。また、これらの債権額の合計額は606百万円です。
4. 元本補てん契約のある信託の貸出金 平成29年度中間期末（平成29年9月30日現在）17,221百万円のうち、破綻先債権額は3百万円、延滞債権額は0百万円、3カ月以上延滞債権額は5百万円、貸出条件緩和債権額は231百万円です。また、これらの債権額の合計額は240百万円です。

(参考)

前記(注)2.に記載の共同信託他社管理財産には、三菱UFJ信託銀行株式会社と日本マスタートラスト信託銀行株式会社が職務分担型共同受託方式により受託している信託財産(以下、「職務分担型共同受託財産」という。)が平成28年度中間期末66,299,479百万円、平成29年度中間期末68,262,380百万円含まれています。

前記信託財産残高表に職務分担型共同受託財産を合算した信託財産残高表は以下のとおりです。

信託財産残高表(職務分担型共同受託財産合算分)

(単位:百万円)

|              | 平成28年度中間期末<br>(平成28年9月30日) | 平成29年度中間期末<br>(平成29年9月30日) |
|--------------|----------------------------|----------------------------|
| <b>資産</b>    |                            |                            |
| 貸出金          | 172,918                    | 267,275                    |
| 有価証券         | 52,375,631                 | 52,166,441                 |
| 信託受益権        | 55,811,032                 | 64,553,174                 |
| 受託有価証券       | 3,727,280                  | 3,704,671                  |
| 金銭債権         | 8,384,845                  | 17,284,680                 |
| 有形固定資産       | 12,035,635                 | 13,022,417                 |
| 無形固定資産       | 206,638                    | 123,356                    |
| その他債権        | 3,420,159                  | 3,985,687                  |
| コールローン       | 624,483                    | 344,687                    |
| 銀行勘定貸        | 7,673,408                  | 8,708,650                  |
| 現金預け金        | 4,748,475                  | 6,581,566                  |
| <b>合計</b>    | <b>149,180,508</b>         | <b>170,742,609</b>         |
| <b>負債</b>    |                            |                            |
| 金銭信託         | 19,311,414                 | 23,294,994                 |
| 年金信託         | 12,843,522                 | 11,632,684                 |
| 財産形成給付信託     | 7,523                      | 7,376                      |
| 投資信託         | 59,138,914                 | 68,783,725                 |
| 金銭信託以外の金銭の信託 | 3,316,252                  | 3,601,804                  |
| 有価証券の信託      | 5,645,901                  | 5,914,396                  |
| 金銭債権の信託      | 7,642,868                  | 16,385,054                 |
| 動産の信託        | 63,438                     | 67,131                     |
| 土地及びその定着物の信託 | 65,798                     | 43,968                     |
| 包括信託         | 41,144,872                 | 41,011,472                 |
| <b>合計</b>    | <b>149,180,508</b>         | <b>170,742,609</b>         |

2. 元本補てん契約のある信託の内訳(信託財産の運用のため再信託された信託を含む)

金銭信託

(単位:百万円)

|           | 平成28年度中間期末       | 平成29年度中間期末       |
|-----------|------------------|------------------|
| <b>資産</b> |                  |                  |
| 貸出金       | 20,489           | 17,221           |
| 有価証券      | 110,975          | 88,163           |
| その他       | 5,411,379        | 6,433,224        |
| <b>合計</b> | <b>5,542,844</b> | <b>6,538,610</b> |
| <b>負債</b> |                  |                  |
| 元本        | 5,532,965        | 6,521,892        |
| 債権償却準備金   | 64               | 51               |
| その他       | 9,814            | 16,666           |
| <b>合計</b> | <b>5,542,844</b> | <b>6,538,610</b> |



### 3. 金銭信託等の受入状況

#### (1) 主な信託財産の受託残高及び総資金量

(単位：億円)

|             | 平成28年度中間期末     | 平成29年度中間期末     |
|-------------|----------------|----------------|
| 金銭信託        | 27,141         | 30,391         |
| 年金信託        | —              | —              |
| 財産形成給付信託    | 75             | 73             |
| <b>合計</b>   | <b>27,216</b>  | <b>30,465</b>  |
| 預金          | 145,324        | 144,481        |
| 譲渡性預金       | 42,534         | 50,159         |
| <b>総資金量</b> | <b>215,075</b> | <b>225,105</b> |

(注) 職務分担型共同受託財産を含めて算出した金額は以下のとおりです。

(単位：億円)

|             | 平成28年度中間期末     | 平成29年度中間期末     |
|-------------|----------------|----------------|
| 金銭信託        | 193,114        | 232,949        |
| 年金信託        | 128,435        | 116,326        |
| 財産形成給付信託    | 75             | 73             |
| <b>合計</b>   | <b>321,624</b> | <b>349,350</b> |
| 預金          | 145,324        | 144,481        |
| 譲渡性預金       | 42,534         | 50,159         |
| <b>総資金量</b> | <b>509,483</b> | <b>543,991</b> |

#### (2) 信託期間別元本残高

##### 金銭信託

(単位：億円)

|           | 平成28年度中間期末    | 平成29年度中間期末    |
|-----------|---------------|---------------|
| 1年未満      | 190           | 1,718         |
| 1年以上2年未満  | 25            | 193           |
| 2年以上5年未満  | 1,107         | 2,018         |
| 5年以上      | 21,729        | 22,289        |
| その他のもの    | 499           | 444           |
| <b>合計</b> | <b>23,550</b> | <b>26,665</b> |

(注) その他のものは、金銭信託（1カ月据置型）、金銭信託（新1年据置型）です。

### 4. 金銭信託等の運用状況

(単位：億円)

|                    | 平成28年度中間期末   | 平成29年度中間期末   |
|--------------------|--------------|--------------|
| <b>金銭信託</b>        |              |              |
| 貸出金                | 1,729        | 2,672        |
| 有価証券               | 1,136        | 902          |
| <b>計</b>           | <b>2,865</b> | <b>3,575</b> |
| <b>年金信託</b>        |              |              |
| 貸出金                | —            | —            |
| 有価証券               | —            | —            |
| <b>計</b>           | <b>—</b>     | <b>—</b>     |
| <b>財産形成給付信託</b>    |              |              |
| 貸出金                | —            | —            |
| 有価証券               | —            | —            |
| <b>計</b>           | <b>—</b>     | <b>—</b>     |
| <b>貸出金合計</b>       | <b>1,729</b> | <b>2,672</b> |
| <b>有価証券合計</b>      | <b>1,136</b> | <b>902</b>   |
| <b>貸出金及び有価証券合計</b> | <b>2,865</b> | <b>3,575</b> |

(注) 職務分担型共同受託財産を含めて算出した金額は次のとおりです。

(単位：億円)

|                    | 平成28年度中間期末     | 平成29年度中間期末     |
|--------------------|----------------|----------------|
| <b>金銭信託</b>        |                |                |
| 貸出金                | 1,729          | 2,672          |
| 有価証券               | 129,881        | 150,693        |
| <b>計</b>           | <b>131,611</b> | <b>153,366</b> |
| <b>年金信託</b>        |                |                |
| 貸出金                | —              | —              |
| 有価証券               | 103,228        | 91,050         |
| <b>計</b>           | <b>103,228</b> | <b>91,050</b>  |
| <b>財産形成給付信託</b>    |                |                |
| 貸出金                | —              | —              |
| 有価証券               | —              | —              |
| <b>計</b>           | <b>—</b>       | <b>—</b>       |
| <b>貸出金合計</b>       | <b>1,729</b>   | <b>2,672</b>   |
| <b>有価証券合計</b>      | <b>233,110</b> | <b>241,743</b> |
| <b>貸出金及び有価証券合計</b> | <b>234,839</b> | <b>244,416</b> |

## 5. 貸出金の状況

「5. 貸出金の状況」における各表の貸出金は、金銭信託、年金信託及び財産形成給付信託にかかるものです。

### (1) 貸出金科目別残高

(単位：億円)

|           | 平成28年度中間期末   | 平成29年度中間期末   |
|-----------|--------------|--------------|
| 証書貸付      | 1,729        | 2,672        |
| 手形貸付      | 0            | 0            |
| 割引手形      | —            | —            |
| <b>合計</b> | <b>1,729</b> | <b>2,672</b> |

### (2) 貸出金の契約期間別残高

(単位：億円)

|           | 平成28年度中間期末   | 平成29年度中間期末   |
|-----------|--------------|--------------|
| 1年以下      | 72           | 264          |
| 1年超3年以下   | 137          | 182          |
| 3年超5年以下   | 264          | 328          |
| 5年超7年以下   | 292          | 372          |
| 7年超       | 963          | 1,524        |
| <b>合計</b> | <b>1,729</b> | <b>2,672</b> |

### (3) 貸出金の業種別内訳

(単位：億円)

|           | 平成28年度中間期末             | 平成29年度中間期末             |
|-----------|------------------------|------------------------|
| 金融業、保険業   | 65 (3.76%)             | 311 (11.67%)           |
| 不動産業      | 64 (3.76%)             | 47 (1.78%)             |
| 各種サービス業   | 0 (0.00%)              | 0 (0.00%)              |
| 地方公共団体    | 48 (2.79%)             | 47 (1.78%)             |
| その他       | 1,550 (89.69%)         | 2,265 (84.77%)         |
| <b>合計</b> | <b>1,729 (100.00%)</b> | <b>2,672 (100.00%)</b> |

(注) ( ) 内は構成比です。

### (4) 貸出金の使途別内訳

(単位：億円)

|           | 平成28年度中間期末             | 平成29年度中間期末             |
|-----------|------------------------|------------------------|
| 設備資金      | 1,592 (92.07%)         | 2,257 (84.47%)         |
| 運転資金      | 137 (7.93%)            | 415 (15.53%)           |
| <b>合計</b> | <b>1,729 (100.00%)</b> | <b>2,672 (100.00%)</b> |

(注) ( ) 内は構成比です。

## (5) 貸出金の担保別内訳

(単位: 億円)

|           | 平成28年度中間期末   | 平成29年度中間期末   |
|-----------|--------------|--------------|
| 有価証券      | —            | —            |
| 債権        | —            | —            |
| 商品        | —            | —            |
| 不動産       | 81           | 68           |
| その他       | 4            | 4            |
| <b>計</b>  | <b>86</b>    | <b>72</b>    |
| 保証        | 834          | 1,311        |
| 信用        | 808          | 1,288        |
| <b>合計</b> | <b>1,729</b> | <b>2,672</b> |

## (6) 中小企業等に対する貸出金

(単位: 億円)

|                | 平成28年度中間期末 | 平成29年度中間期末 |
|----------------|------------|------------|
| 総貸出金残高 (A)     | 1,729      | 2,672      |
| 中小企業等貸出金残高 (B) | 1,615      | 2,383      |
| 比率 (B) / (A)   | 93.45%     | 89.17%     |

(注) 中小企業等とは、資本金3億円（ただし、卸売業は1億円、サービス業、小売業、飲食業は5,000万円）以下の会社又は常用する従業員が300人（ただし、卸売業、サービス業は100人、小売業、飲食業は50人）以下の会社及び個人です。

## (7) 消費者ローン残高

(単位: 億円)

|           | 平成28年度中間期末 | 平成29年度中間期末 |
|-----------|------------|------------|
| 消費者ローン残高  | 90         | 77         |
| うち住宅ローン残高 | 90         | 76         |

## (8) 元本補てん契約のある信託の貸出金におけるリスク管理債権の状況

## リスク管理債権

(単位: 億円)

|            | 平成28年度中間期末 | 平成29年度中間期末 |
|------------|------------|------------|
| 破綻先債権額     | 0          | 0          |
| 延滞債権額      | 0          | 0          |
| 3カ月以上延滞債権額 | 0          | 0          |
| 貸出条件緩和債権額  | 5          | 2          |
| <b>合計</b>  | <b>6</b>   | <b>2</b>   |
| 貸出金残高      | 204        | 172        |
| 貸出金に占める比率  | 2.96%      | 1.39%      |

## (9) 元本補てん契約のある信託における金融再生法基準による債権額

(単位: 億円)

|                   | 平成28年度中間期末 | 平成29年度中間期末 |
|-------------------|------------|------------|
| 破産更生債権及びこれらに準ずる債権 | 0          | 0          |
| 危険債権              | 1          | 0          |
| 要管理債権             | 4          | 1          |
| <b>計</b>          | <b>6</b>   | <b>2</b>   |
| 正常債権              | 198        | 169        |
| <b>合計</b>         | <b>204</b> | <b>172</b> |
| 開示債権比率            | 2.96%      | 1.39%      |

(注) 貸出金等の各勘定について債務者の財政状態及び経営成績等を基礎として次のとおり区分し、開示しています。

1. 「破産更生債権及びこれらに準ずる債権」とは、破産手続開始、更生手続開始、再生手続開始の申立て等の事由により経営破綻に陥っている債務者に対する債権及びこれらに準ずる債権です。
2. 「危険債権」とは、債務者が経営破綻の状態には至っていないが、財政状態及び経営成績が悪化し、契約に従った債権の元本の回収及び利息の受取りができない可能性の高い債権です。
3. 「要管理債権」とは、3カ月以上延滞債権及び貸出条件緩和債権です。
4. 「正常債権」とは、債務者の財政状態及び経営成績に特に問題がないものとして、上記1.から3.までに掲げる債権以外のものに区分される債権です。

## 6. 有価証券残高

(単位：億円)

|           | 平成28年度中間期末             | 平成29年度中間期末           |
|-----------|------------------------|----------------------|
| 国債        | 442 (38.96%)           | 405 (44.98%)         |
| 地方債       | 6 (0.57%)              | 5 (0.60%)            |
| 短期社債      | — (—)                  | — (—)                |
| 社債        | 8 (0.78%)              | 4 (0.50%)            |
| 株式        | — (—)                  | — (—)                |
| その他の証券    | 678 (59.69%)           | 486 (53.92%)         |
| <b>合計</b> | <b>1,136 (100.00%)</b> | <b>902 (100.00%)</b> |

- (注) 1. 有価証券残高は、金銭信託、年金信託及び財産形成給付信託の有価証券の合計額です。  
 2. ( ) 内は構成比です。  
 3. 職務分担型共同受託財産を含めて算出した金額は以下のとおりです。

(単位：億円)

|           | 平成28年度中間期末               | 平成29年度中間期末               |
|-----------|--------------------------|--------------------------|
| 国債        | 52,524 (22.53%)          | 47,704 (19.73%)          |
| 地方債       | 2,605 (1.12%)            | 2,378 (0.99%)            |
| 短期社債      | 4,149 (1.78%)            | 7,034 (2.91%)            |
| 社債        | 9,228 (3.96%)            | 9,915 (4.10%)            |
| 株式        | 31,266 (13.41%)          | 31,506 (13.03%)          |
| その他の証券    | 133,335 (57.20%)         | 143,204 (59.24%)         |
| <b>合計</b> | <b>233,110 (100.00%)</b> | <b>241,743 (100.00%)</b> |

## 7. 元本補てん契約のある信託の有価証券等時価情報

### 金銭信託

#### (1) 有価証券

(単位：億円)

|        | 平成28年度中間期末 | 平成29年度中間期末 |
|--------|------------|------------|
| 信託財産残高 | 1,109      | 881        |
| 時価     | 1,172      | 931        |
| 評価損益   | 62         | 49         |

(注) 時価相当額として価格等の算定が可能なものについて時価を付しています。

#### (2) デリバティブ取引等

(単位：億円)

|      | 平成28年度中間期末 | 平成29年度中間期末 |
|------|------------|------------|
| 評価損益 | 16         | 20         |

## ● 銀行業務の状況（単体）

### 1. 貸出金の状況

#### (1) 貸出金科目別期末残高

（単位：億円）

|               | 平成28年度中間期末                  | 平成29年度中間期末                  |
|---------------|-----------------------------|-----------------------------|
| <b>国内業務部門</b> |                             |                             |
| 割引手形          | 7                           | 8                           |
| 手形貸付          | 1,871                       | 1,850                       |
| 証書貸付          | 85,123                      | 88,265                      |
| 当座貸越          | 13,848                      | 13,443                      |
| <b>計</b>      | <b>100,850</b><br>(74.30%)  | <b>103,567</b><br>(72.39%)  |
| <b>国際業務部門</b> |                             |                             |
| 割引手形          | —                           | —                           |
| 手形貸付          | 1,468                       | 2,013                       |
| 証書貸付          | 33,413                      | 37,494                      |
| 当座貸越          | 0                           | 0                           |
| <b>計</b>      | <b>34,881</b><br>(25.70%)   | <b>39,508</b><br>(27.61%)   |
| <b>合計</b>     | <b>135,732</b><br>(100.00%) | <b>143,076</b><br>(100.00%) |

(注) ( ) 内は構成比です。

#### (2) 貸出金科目別平均残高

（単位：億円）

|               | 平成28年度中間期                   | 平成29年度中間期                   |
|---------------|-----------------------------|-----------------------------|
| <b>国内業務部門</b> |                             |                             |
| 割引手形          | 7                           | 6                           |
| 手形貸付          | 1,526                       | 1,337                       |
| 証書貸付          | 81,200                      | 87,636                      |
| 当座貸越          | 12,312                      | 12,861                      |
| <b>計</b>      | <b>95,047</b><br>(72.10%)   | <b>101,840</b><br>(71.40%)  |
| <b>国際業務部門</b> |                             |                             |
| 割引手形          | —                           | —                           |
| 手形貸付          | 1,874                       | 1,983                       |
| 証書貸付          | 34,898                      | 38,807                      |
| 当座貸越          | 0                           | 0                           |
| <b>計</b>      | <b>36,772</b><br>(27.90%)   | <b>40,791</b><br>(28.60%)   |
| <b>合計</b>     | <b>131,819</b><br>(100.00%) | <b>142,632</b><br>(100.00%) |

(注) 1. ( ) 内は構成比です。

2. 国際業務部門の国内店外貸建取引の平均残高は、月次カレント方式（前月末TT仲値を当該月のノンエクスチェンジ取引に適用する方式）により算出しています。

#### (3) 貸出金の残存期間別残高

（単位：億円）

|               | 平成28年度中間期末     | 平成29年度中間期末     |
|---------------|----------------|----------------|
| <b>貸出金</b>    |                |                |
| 1年以下          | 25,596         | 30,101         |
| 1年超3年以下       | 28,268         | 28,859         |
| 3年超5年以下       | 25,258         | 27,349         |
| 5年超7年以下       | 12,850         | 12,416         |
| 7年超           | 29,910         | 30,904         |
| 期間の定めのないもの    | 13,848         | 13,443         |
| <b>合計</b>     | <b>135,732</b> | <b>143,076</b> |
| <b>変動金利貸出</b> |                |                |
| 1年超3年以下       | 21,218         | 21,934         |
| 3年超5年以下       | 20,586         | 18,926         |
| 5年超7年以下       | 9,754          | 8,772          |
| 7年超           | 20,133         | 19,200         |
| 期間の定めのないもの    | 13,848         | 13,443         |
| <b>固定金利貸出</b> |                |                |
| 1年超3年以下       | 7,050          | 6,925          |
| 3年超5年以下       | 4,671          | 8,423          |
| 5年超7年以下       | 3,095          | 3,644          |
| 7年超           | 9,776          | 11,704         |
| 期間の定めのないもの    | —              | —              |

(注) 残存期間1年以下の貸出金については、変動金利・固定金利の区別をしていません。

## (4) 貸出金の業種別内訳

(単位：億円)

|                           | 平成28年度中間期末               | 平成29年度中間期末               |
|---------------------------|--------------------------|--------------------------|
| <b>国内（特別国際金融取引勘定分を除く）</b> |                          |                          |
| 製造業                       | 19,881 (17.38%)          | 19,548 (16.51%)          |
| 農業、林業、漁業、鉱業、採石業、砂利採取業     | 34 (0.03%)               | 31 (0.03%)               |
| 建設業                       | 953 (0.83%)              | 920 (0.78%)              |
| 電気・ガス・熱供給・水道業             | 3,917 (3.42%)            | 4,312 (3.64%)            |
| 情報通信業                     | 2,944 (2.57%)            | 2,873 (2.42%)            |
| 運輸業、郵便業                   | 5,845 (5.11%)            | 6,382 (5.39%)            |
| 卸売業、小売業                   | 8,648 (7.56%)            | 8,463 (7.15%)            |
| 金融業、保険業                   | 23,319 (20.38%)          | 24,491 (20.68%)          |
| 不動産業                      | 18,999 (16.61%)          | 18,302 (15.45%)          |
| 物品賃貸業                     | 7,196 (6.29%)            | 7,623 (6.44%)            |
| 各種サービス業                   | 1,510 (1.32%)            | 1,431 (1.21%)            |
| 地方公共団体                    | 34 (0.03%)               | 23 (0.02%)               |
| その他                       | 21,134 (18.47%)          | 24,015 (20.28%)          |
| <b>計</b>                  | <b>114,421 (100.00%)</b> | <b>118,419 (100.00%)</b> |
| <b>海外及び特別国際金融取引勘定分</b>    |                          |                          |
| 政府等                       | 100 (0.47%)              | 225 (0.91%)              |
| 金融機関                      | 12,124 (56.89%)          | 13,426 (54.46%)          |
| 商工業                       | 6,092 (28.59%)           | 7,959 (32.28%)           |
| その他                       | 2,993 (14.05%)           | 3,045 (12.35%)           |
| <b>計</b>                  | <b>21,310 (100.00%)</b>  | <b>24,656 (100.00%)</b>  |
| <b>合計</b>                 | <b>135,732</b>           | <b>143,076</b>           |

(注) ( ) 内は構成比です。

## (5) 貸出金の使途別内訳

(単位：億円)

|           | 平成28年度中間期末               | 平成29年度中間期末               |
|-----------|--------------------------|--------------------------|
| 設備資金      | 38,498 (28.36%)          | 39,143 (27.36%)          |
| 運転資金      | 97,233 (71.64%)          | 103,932 (72.64%)         |
| <b>合計</b> | <b>135,732 (100.00%)</b> | <b>143,076 (100.00%)</b> |

(注) ( ) 内は構成比です。

## (6) 貸出金の担保別内訳

(単位：億円)

|           | 平成28年度中間期末     | 平成29年度中間期末     |
|-----------|----------------|----------------|
| 有価証券      | 1,669          | 1,555          |
| 債権        | 1,309          | 1,365          |
| 商品        | 0              | —              |
| 不動産       | 7,448          | 7,265          |
| その他       | 6,436          | 7,026          |
| <b>計</b>  | <b>16,863</b>  | <b>17,212</b>  |
| 保証        | 23,841         | 23,547         |
| 信用        | 95,027         | 102,315        |
| <b>合計</b> | <b>135,732</b> | <b>143,076</b> |

## (7) 中小企業等に対する貸出金（国内店）

(単位：億円)

|                | 平成28年度中間期末 | 平成29年度中間期末 |
|----------------|------------|------------|
| 総貸出金残高 (A)     | 114,421    | 118,419    |
| 中小企業等貸出金残高 (B) | 56,226     | 57,655     |
| 比率 (B) / (A)   | 49.14%     | 48.68%     |

(注) 1. 貸出金残高には、特別国際金融取引勘定分は含まれていません。

2. 中小企業等とは、資本金3億円（ただし、卸売業は1億円、サービス業、小売業、飲食業は5,000万円）以下の会社又は常用する従業員が300人（ただし、卸売業、サービス業は100人、小売業、飲食業は50人）以下の会社及び個人です。

## (8) 消費者ローン残高

(単位：億円)

|           | 平成28年度中間期末 | 平成29年度中間期末 |
|-----------|------------|------------|
| 消費者ローン残高  | 13,648     | 13,266     |
| うち住宅ローン残高 | 13,598     | 13,225     |

## (9) 特定海外債権残高

(単位：億円、カ国)

|             | 平成28年度中間期末 | 平成29年度中間期末 |
|-------------|------------|------------|
| アルゼンチン      | 0          | 0          |
| エクアドル       | 0          | 0          |
| (総資産に対する割合) | (0.00%)    | (0.00%)    |
| 合計          | 0          | 0          |
| 対象国数        | 2          | 2          |

## (10) 貸出金償却

(単位：億円)

|        | 平成28年度中間期 | 平成29年度中間期 |
|--------|-----------|-----------|
| 貸出金償却額 | 3         | 0         |

## (11) リスク管理債権の状況

リスク管理債権額については、部分直接償却後の金額を記載しています。

## ① リスク管理債権

(単位：億円)

|            | 平成28年度中間期末 | 平成29年度中間期末 |
|------------|------------|------------|
| 破綻先債権額     | 5          | 4          |
| 延滞債権額      | 102        | 119        |
| 3カ月以上延滞債権額 | 2          | 0          |
| 貸出条件緩和債権額  | 271        | 306        |
| 合計         | 381        | 431        |
| 貸出金残高      | 135,732    | 143,076    |
| 貸出金に占める比率  | 0.28%      | 0.30%      |

## ② リスク管理債権に対する引当率

(単位：億円)

|               | 平成28年度中間期末 | 平成29年度中間期末 |
|---------------|------------|------------|
| 貸倒引当金 (A)     | 341        | 462        |
| リスク管理債権 (B)   | 381        | 431        |
| 引当率 (A) / (B) | 89.37%     | 107.32%    |

(注) 貸倒引当金には、リスク管理債権以外の債権に対応する引当金が含まれているほか、担保・保証等による保全については考慮されていません。

## 2. 貸倒引当金の期末残高及び期中増減額

(単位：億円)

|            | 平成28年度中間期 |       |       |      | 平成29年度中間期 |       |       |      |
|------------|-----------|-------|-------|------|-----------|-------|-------|------|
|            | 期首残高      | 期中増加額 | 期中減少額 | 期末残高 | 期首残高      | 期中増加額 | 期中減少額 | 期末残高 |
| 一般貸倒引当金    | 263       | 330   | 263   | 330  | 583       | 416   | 583   | 416  |
| 個別貸倒引当金    | 107       | 10    | 107   | 10   | 9         | 45    | 9     | 45   |
| 特定海外債権引当勘定 | 0         | 0     | 0     | 0    | 0         | 0     | 0     | 0    |
| 合計         | 370       | 341   | 370   | 341  | 593       | 462   | 593   | 462  |

### 3. 金融再生法に基づく資産査定額

(単位: 億円)

|                   | 平成28年度中間期末     | 平成29年度中間期末     |
|-------------------|----------------|----------------|
| 破産更生債権及びこれらに準ずる債権 | 19             | 16             |
| 危険債権              | 88             | 108            |
| 要管理債権             | 273            | 307            |
| <b>計</b>          | <b>381</b>     | <b>432</b>     |
| 正常債権              | 139,969        | 146,235        |
| <b>合計</b>         | <b>140,351</b> | <b>146,667</b> |
| 開示債権比率            | 0.27%          | 0.29%          |

(注)「金融機能の再生のための緊急措置に関する法律」(平成10年法律第132号)第6条に基づき、中間貸借対照表の有価証券中の社債(当該社債を有する金融機関がその元本の償還及び利息の支払の全部又は一部について保証しているものであって、当該社債の発行が金融商品取引法(昭和23年法律第25号)第2条第3項に規定する有価証券の私募によるものに限る)、貸出金、外国為替、その他資産中の未収利息及び仮払金、支払承諾見返の各勘定に計上されるもの並びに中間貸借対照表に注記することとされている有価証券の貸付けを行っている場合のその有価証券(使用貸借又は貸借契約によるものに限る)について債務者の財政状態及び経営成績等を基礎として次のとおり区分し、開示しています。

1. 「破産更生債権及びこれらに準ずる債権」とは、破産手続開始、更生手続開始、再生手続開始の申立て等の事由により経営破綻に陥っている債務者に対する債権及びこれらに準ずる債権です。
2. 「危険債権」とは、債務者が経営破綻の状態には至っていないが、財政状態及び経営成績が悪化し、契約に従った債権の元本の回収及び利息の受取りができない可能性の高い債権です。
3. 「要管理債権」とは、3カ月以上延滞債権及び貸出条件緩和債権です。
4. 「正常債権」とは、債務者の財政状態及び経営成績に特に問題がないものとして、上記1.から3.までに掲げる債権以外のものに区分される債権です。

### 4. 有価証券の状況

#### (1) 有価証券期末残高

(単位: 億円)

|               | 平成28年度中間期末                  | 平成29年度中間期末                  |
|---------------|-----------------------------|-----------------------------|
| <b>国内業務部門</b> |                             |                             |
| 国債            | 58,097                      | 36,612                      |
| 地方債           | 399                         | 0                           |
| 短期社債          | —                           | —                           |
| 社債            | 5,710                       | 2,318                       |
| 株式            | 10,328                      | 12,083                      |
| その他の証券        | 6,916                       | 8,491                       |
| <b>計</b>      | <b>81,451</b><br>(50.05%)   | <b>59,506</b><br>(40.26%)   |
| <b>国際業務部門</b> |                             |                             |
| その他の証券        | 81,279                      | 88,284                      |
| うち外国債券        | 76,573                      | 79,454                      |
| 外国株式          | 1,953                       | 2,645                       |
| <b>計</b>      | <b>81,279</b><br>(49.95%)   | <b>88,284</b><br>(59.74%)   |
| <b>合計</b>     | <b>162,730</b><br>(100.00%) | <b>147,790</b><br>(100.00%) |

(注) ( ) 内は構成比です。

#### (2) 有価証券平均残高

(単位: 億円)

|               | 平成28年度中間期                   | 平成29年度中間期                   |
|---------------|-----------------------------|-----------------------------|
| <b>国内業務部門</b> |                             |                             |
| 国債            | 61,066                      | 38,899                      |
| 地方債           | 394                         | 0                           |
| 短期社債          | —                           | —                           |
| 社債            | 5,702                       | 2,239                       |
| 株式            | 6,324                       | 6,234                       |
| その他の証券        | 5,604                       | 7,253                       |
| <b>計</b>      | <b>79,092</b><br>(51.36%)   | <b>54,627</b><br>(40.35%)   |
| <b>国際業務部門</b> |                             |                             |
| その他の証券        | 74,889                      | 80,755                      |
| うち外国債券        | 70,793                      | 74,008                      |
| 外国株式          | 1,963                       | 2,186                       |
| <b>計</b>      | <b>74,889</b><br>(48.64%)   | <b>80,755</b><br>(59.65%)   |
| <b>合計</b>     | <b>153,982</b><br>(100.00%) | <b>135,383</b><br>(100.00%) |

(注) 1. ( ) 内は構成比です。

2. 国際業務部門の国内店外貨建取引の平均残高は、月次カレント方式(前月末TT仲値を当該月のノンエクスチェンジ取引に適用する方式)により算出しています。



## (3) 有価証券の残存期間別残高

(単位：億円)

|               | 平成28年度中間期末    | 平成29年度中間期末    |
|---------------|---------------|---------------|
| <b>国債</b>     |               |               |
| 1年以下          | 8,590         | 9,481         |
| 1年超3年以下       | 23,232        | 18,559        |
| 3年超5年以下       | 13,478        | 6,033         |
| 5年超7年以下       | 3,500         | 201           |
| 7年超10年以下      | 1,989         | —             |
| 10年超          | 7,305         | 2,336         |
| 期間の定めのないもの    | —             | —             |
| <b>計</b>      | <b>58,097</b> | <b>36,612</b> |
| <b>地方債</b>    |               |               |
| 1年以下          | —             | 0             |
| 1年超3年以下       | 0             | —             |
| 3年超5年以下       | —             | —             |
| 5年超7年以下       | —             | —             |
| 7年超10年以下      | 359           | 0             |
| 10年超          | 39            | 0             |
| 期間の定めのないもの    | —             | —             |
| <b>計</b>      | <b>399</b>    | <b>0</b>      |
| <b>社債</b>     |               |               |
| 1年以下          | 404           | 453           |
| 1年超3年以下       | 789           | 366           |
| 3年超5年以下       | 596           | 812           |
| 5年超7年以下       | 1,245         | 210           |
| 7年超10年以下      | 2,231         | 237           |
| 10年超          | 443           | 237           |
| 期間の定めのないもの    | —             | —             |
| <b>計</b>      | <b>5,710</b>  | <b>2,318</b>  |
| <b>株式</b>     |               |               |
| 期間の定めのないもの    | 10,328        | 12,083        |
| <b>計</b>      | <b>10,328</b> | <b>12,083</b> |
| <b>その他の証券</b> |               |               |
| 1年以下          | 7,891         | 5,027         |
| 1年超3年以下       | 14,854        | 18,300        |
| 3年超5年以下       | 14,237        | 11,046        |
| 5年超7年以下       | 7,077         | 9,839         |
| 7年超10年以下      | 20,645        | 19,352        |
| 10年超          | 17,454        | 22,407        |
| 期間の定めのないもの    | 6,034         | 10,800        |
| <b>計</b>      | <b>88,195</b> | <b>96,775</b> |
| <b>うち外国債券</b> |               |               |
| 1年以下          | 7,421         | 4,590         |
| 1年超3年以下       | 13,258        | 15,126        |
| 3年超5年以下       | 12,607        | 9,667         |
| 5年超7年以下       | 6,844         | 9,011         |
| 7年超10年以下      | 18,998        | 18,686        |
| 10年超          | 17,444        | 22,373        |
| 期間の定めのないもの    | —             | —             |
| <b>計</b>      | <b>76,573</b> | <b>79,454</b> |
| <b>うち外国株式</b> |               |               |
| 期間の定めのないもの    | 1,953         | 2,645         |
| <b>計</b>      | <b>1,953</b>  | <b>2,645</b>  |

## 5. 支払承諾期末残高

(単位：億円)

|           | 平成28年度中間期末   | 平成29年度中間期末   |
|-----------|--------------|--------------|
| 手形引受      | —            | —            |
| 信用状発行     | —            | —            |
| 債務保証      | 3,844        | 2,637        |
| <b>合計</b> | <b>3,844</b> | <b>2,637</b> |

## 6. 支払承諾見返の担保別内訳

(単位：億円)

|           | 平成28年度中間期末   | 平成29年度中間期末   |
|-----------|--------------|--------------|
| 有価証券      | 32           | 32           |
| 債権        | 0            | 0            |
| 商品        | —            | —            |
| 不動産       | 0            | —            |
| その他       | 26           | 23           |
| <b>計</b>  | <b>59</b>    | <b>56</b>    |
| 保証        | 131          | 114          |
| 信用        | 3,653        | 2,466        |
| <b>合計</b> | <b>3,844</b> | <b>2,637</b> |

## 7. 預金の状況

### (1) 預金種類別期末残高

(単位：億円)

|               | 平成28年度中間期末                  | 平成29年度中間期末                  |
|---------------|-----------------------------|-----------------------------|
| <b>国内業務部門</b> |                             |                             |
| 流動性預金         | 49,213                      | 45,505                      |
| 定期性預金         | 77,439                      | 79,823                      |
| その他の預金        | 684                         | 634                         |
| <b>小計</b>     | <b>127,337</b>              | <b>125,962</b>              |
| 譲渡性預金         | 24,991                      | 26,397                      |
| <b>計</b>      | <b>152,328</b><br>(81.09%)  | <b>152,360</b><br>(78.28%)  |
| <b>国際業務部門</b> |                             |                             |
| 流動性預金         | 9                           | 12                          |
| 定期性預金         | 12,721                      | 13,961                      |
| その他の預金        | 5,256                       | 4,544                       |
| <b>小計</b>     | <b>17,986</b>               | <b>18,519</b>               |
| 譲渡性預金         | 17,543                      | 23,761                      |
| <b>計</b>      | <b>35,530</b><br>(18.91%)   | <b>42,280</b><br>(21.72%)   |
| <b>合計</b>     | <b>187,858</b><br>(100.00%) | <b>194,640</b><br>(100.00%) |

(注) 1. ( ) 内は構成比です。

2. 流動性預金 = 当座預金 + 普通預金 + 通知預金

3. 定期性預金 = 定期預金

## (2) 預金種類別平均残高

(単位: 億円)

|               | 平成28年度中間期                   | 平成29年度中間期                   |
|---------------|-----------------------------|-----------------------------|
| <b>国内業務部門</b> |                             |                             |
| 流動性預金         | 38,982                      | 49,785                      |
| 定期性預金         | 79,306                      | 78,225                      |
| その他の預金        | 1,148                       | 842                         |
| <b>小計</b>     | <b>119,438</b>              | <b>128,853</b>              |
| 譲渡性預金         | 22,197                      | 25,798                      |
| <b>計</b>      | <b>141,635</b><br>(78.65%)  | <b>154,652</b><br>(77.31%)  |
| <b>国際業務部門</b> |                             |                             |
| 流動性預金         | 10                          | 14                          |
| 定期性預金         | 12,686                      | 15,467                      |
| その他の預金        | 5,822                       | 7,247                       |
| <b>小計</b>     | <b>18,520</b>               | <b>22,729</b>               |
| 譲渡性預金         | 19,920                      | 22,657                      |
| <b>計</b>      | <b>38,441</b><br>(21.35%)   | <b>45,386</b><br>(22.69%)   |
| <b>合計</b>     | <b>180,077</b><br>(100.00%) | <b>200,038</b><br>(100.00%) |

(注) 1. ( ) 内は構成比です。

2. 流動性預金=当座預金+普通預金+通知預金

3. 定期性預金=定期預金

4. 国際業務部門の国内店外貨建取引の平均残高は月次カレント方式(前月末TT仲値を当該月のノンエクスチェンジ取引に適用する方式)により算出しています。

## (3) 定期預金の残存期間別残高

(単位: 億円)

|                 | 平成28年度中間期末    | 平成29年度中間期末    |
|-----------------|---------------|---------------|
| <b>定期預金</b>     |               |               |
| 3カ月未満           | 25,993        | 30,515        |
| 3カ月以上6カ月未満      | 13,882        | 17,106        |
| 6カ月以上1年未満       | 18,191        | 18,199        |
| 1年以上2年未満        | 20,058        | 18,006        |
| 2年以上3年未満        | 5,115         | 5,113         |
| 3年以上            | 6,919         | 4,843         |
| <b>合計</b>       | <b>90,161</b> | <b>93,784</b> |
| <b>固定金利定期預金</b> |               |               |
| 3カ月未満           | 14,656        | 18,527        |
| 3カ月以上6カ月未満      | 12,578        | 15,148        |
| 6カ月以上1年未満       | 17,430        | 17,622        |
| 1年以上2年未満        | 19,486        | 17,502        |
| 2年以上3年未満        | 4,727         | 4,592         |
| 3年以上            | 5,881         | 4,016         |
| <b>変動金利定期預金</b> |               |               |
| 3カ月未満           | 229           | 150           |
| 3カ月以上6カ月未満      | 163           | 92            |
| 6カ月以上1年未満       | 287           | 319           |
| 1年以上2年未満        | 571           | 502           |
| 2年以上3年未満        | 387           | 520           |
| 3年以上            | 1,038         | 826           |
| <b>その他</b>      |               |               |
| 3カ月未満           | 11,107        | 11,836        |
| 3カ月以上6カ月未満      | 1,140         | 1,866         |
| 6カ月以上1年未満       | 473           | 257           |
| 1年以上2年未満        | —             | 1             |
| 2年以上3年未満        | —             | —             |
| 3年以上            | —             | —             |

## 8. 預貸率・預証率

(単位：%)

|            |           | 平成28年度中間期    | 平成29年度中間期    |
|------------|-----------|--------------|--------------|
| <b>預貸率</b> |           |              |              |
| 期末残高       | 国内業務部門    | 66.04        | 67.74        |
|            | 国際業務部門    | 98.17        | 93.44        |
|            | <b>全店</b> | <b>72.12</b> | <b>73.33</b> |
| 期中平均       | 国内業務部門    | 66.91        | 65.62        |
|            | 国際業務部門    | 95.65        | 89.87        |
|            | <b>全店</b> | <b>73.05</b> | <b>71.12</b> |
| <b>預証率</b> |           |              |              |
| 期末残高       | 国内業務部門    | 53.47        | 39.05        |
|            | 国際業務部門    | 228.75       | 208.80       |
|            | <b>全店</b> | <b>86.62</b> | <b>75.92</b> |
| 期中平均       | 国内業務部門    | 55.84        | 35.32        |
|            | 国際業務部門    | 194.81       | 177.92       |
|            | <b>全店</b> | <b>85.50</b> | <b>67.67</b> |

(注) 預金には譲渡性預金を含んでいます。

## ● 店舗・人員の状況（単体）

### 1. 国内店舗・海外拠点数

（単位：店、カ所）

|    |        | 平成28年度中間期末 | 平成29年度中間期末 |
|----|--------|------------|------------|
| 国内 | 本支店    | 57         | 56         |
|    | 出張所    | 3          | 0          |
|    | 計      | 60         | 56         |
| 海外 | 支店     | 5          | 4          |
|    | 駐在員事務所 | 2          | 2          |
|    | 計      | 7          | 6          |

（注）1. 上記のほかに、店舗外現金自動設備を設置しています。平成29年度中間期末の店舗外現金自動設備は35,443カ所です。このなかには、コンビニエンスストア等に設置した共同出張所35,441カ所が含まれています。

2. 上記のほかに、信託代理店を設置しています。平成29年度中間期末は68金融機関と信託代理店契約を締結しています。

### 2. 従業員の状況

#### ●旧基準

|      | 平成28年度中間期末 | 平成29年度中間期末 |
|------|------------|------------|
| 従業員数 | 8,608人     | 8,595人     |

（注）従業員数には、海外での現地採用者および勤務の実態が従業員と近い形態である営業等嘱託を含み、その他の嘱託および臨時従業員を含んでいません。また、執行役員を含んでいません。

#### ●新基準

|      | 平成28年度中間期末 | 平成29年度中間期末 |
|------|------------|------------|
| 従業員数 | 7,052人     | 7,158人     |

（注）従業員数には、他社への出向者を含まず、他社からの出向者を含んでいます。また、海外での現地採用者および勤務の実態が従業員と近い形態である営業等嘱託を含み、その他の嘱託、臨時従業員および執行役員を含んでいません。

## ● 資本・株式の状況（単体）

### 1. 資本金の推移

| 年月日         | 増減額（千円） | 資本金（千円）     | 摘要 |
|-------------|---------|-------------|----|
| 平成25年 3月31日 | —       | 324,279,038 |    |
| 平成25年 9月30日 | —       | 324,279,038 |    |
| 平成26年 3月31日 | —       | 324,279,038 |    |
| 平成26年 9月30日 | —       | 324,279,038 |    |
| 平成27年 3月31日 | —       | 324,279,038 |    |
| 平成27年 9月30日 | —       | 324,279,038 |    |
| 平成28年 3月31日 | —       | 324,279,038 |    |
| 平成28年 9月30日 | —       | 324,279,038 |    |
| 平成29年 3月31日 | —       | 324,279,038 |    |
| 平成29年 9月30日 | —       | 324,279,038 |    |

### 2. 発行済株式総数の推移

| 年月日         | 増減株式数（千株） | 発行済株式総数（千株） | 摘要  |
|-------------|-----------|-------------|---|
| 平成25年 3月31日 | —         | 3,369,442   |   |
| 平成25年 9月30日 | —         | 3,369,442   |   |
| 平成26年 3月31日 | —         | 3,369,442   |   |
| 平成26年 8月 1日 | 2         | 3,369,444   | 第一回第三種優先株式の一斉取得に伴う普通株式の発行   |
| 平成26年 8月27日 | △1        | 3,369,443   | 自己株式として当社が保有していた第一回第三種優先株式の消却   |
| 平成26年 9月30日 | —         | 3,369,443   |   |
| 平成27年 3月31日 | —         | 3,369,443   |   |
| 平成27年 6月30日 | 29,743    | 3,399,187   | 株式会社三菱UFJフィナンシャル・グループから承継した三菱UFJ投信株式会社（現 三菱UFJ国際投信株式会社）の株式の対価として普通株式を発行                                 |
| 平成27年 9月30日 | —         | 3,399,187   |   |
| 平成28年 3月31日 | —         | 3,399,187   |   |
| 平成28年 9月30日 | —         | 3,399,187   |   |
| 平成29年 3月31日 | —         | 3,399,187   |   |
| 平成29年 5月31日 | 9,474     | 3,408,662   | 株式会社三菱UFJフィナンシャル・グループから承継したMitsubishi UFJ Investor Services & Banking (Luxembourg) S.A.の株式の対価として普通株式を発行 |
| 平成29年 9月30日 | —         | 3,408,662   |   |

### 3. 大株主

| 普通株式                  | (平成29年9月30日現在) |             |
|-----------------------|----------------|-------------|
|                       | 所有株式数<br>(千株)  | 持株比率<br>(%) |
| 株主名                   |                |             |
| 株式会社三菱UFJフィナンシャル・グループ | 3,408,662      | 100.00      |
| 合計                    | 3,408,662      | 100.00      |