

連結レバレッジ比率の構成に関する開示事項(2020年3月期第1四半期)

【三井住友信託銀行】

(単位:百万円、%)

国際様式 (表2)の 該当番号	国際様式 (表1)の 該当番号	項目	2019年 6月末	2019年 3月末
<b>オン・バランス資産の額</b>				
1		調整項目控除前のオン・バランス資産の額	53,274,956	54,543,698
1a	1	連結貸借対照表における総資産の額	55,956,346	56,941,609
1b	2	連結レバレッジ比率の範囲に含まれない子法人等の資産の額(△)	-	-
1c	7	連結レバレッジ比率の範囲に含まれる子会社の資産の額(連結貸借対照表における総資産の額に含まれる額を除く。)	-	-
1d	3	連結貸借対照表における総資産の額から控除される調整項目以外の資産の額(△)	2,681,389	2,397,911
2	7	Tier1資本に係る調整項目の額(△)	235,384	235,022
3		オン・バランス資産の額 (イ)	53,039,572	54,308,676
<b>デリバティブ取引等に関する額</b>				
4		デリバティブ取引等に関するRCの額に1.4を乗じた額		
		デリバティブ取引等に関する再構築コストの額	517,291	448,438
5		デリバティブ取引等に関するPFEの額に1.4を乗じた額		
		デリバティブ取引等に関するアドオンの額	989,411	987,726
		デリバティブ取引等に関連して現金で差し入れた証拠金の対価の額	428,245	333,486
6		連結貸借対照表から控除されているデリバティブ取引等に関連して差し入れた担保の対価の額		
		連結貸借対照表から控除されているデリバティブ取引等に関連して現金で差し入れた証拠金の対価の額	-	-
7		デリバティブ取引等に関連して現金で差し入れた変動証拠金の対価の額のうち控除する額(△)	133,428	119,286
8		清算会員である銀行又は銀行持株会社が補償を義務付けられていない顧客とのトレード・エクスポージャーの額(△)		
9		クレジット・デリバティブのプロテクションを提供した場合における調整後想定元本の額	101,341	126,192
10		クレジット・デリバティブのプロテクションを提供した場合における調整後想定元本の額から控除した額(△)	63,000	63,600
11	4	デリバティブ取引等に関する額 (ロ)	1,839,862	1,712,957
<b>レポ取引等に関する額</b>				
12		レポ取引等に関する資産の額	930,561	918,547
13		レポ取引等に関する資産の額から控除した額(△)	-	-
14		レポ取引等に関するカウンターパーティ・リスクのエクスポージャーの額	252,908	252,883
15		代理取引のエクスポージャーの額		
16	5	レポ取引等に関する額 (ハ)	1,183,469	1,171,431
<b>オフ・バランス取引に関する額</b>				
17		オフ・バランス取引の想定元本の額	7,547,266	7,541,069
18		オフ・バランス取引に係るエクスポージャーの額への変換調整の額(△)	4,627,768	4,803,322
19	6	オフ・バランス取引に関する額 (ニ)	2,919,498	2,737,747
<b>連結レバレッジ比率</b>				
20		資本の額 (ホ)	2,439,841	2,421,640
21	8	総エクスポージャーの額((イ)+(ロ)+(ハ)+(ニ)) (ヘ)	58,982,403	59,930,811
22		連結レバレッジ比率((ホ)/(ヘ))	4.13%	4.04%