

連結レバレッジ比率の構成に関する開示事項(2021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	2020年 6月末	2020年 3月末
オン・バランス資産の額				
1		調整項目控除前のオン・バランス資産の額	42,210,170	52,422,292
1a	1	連結貸借対照表における総資産の額	45,243,752	56,288,892
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(△)	3,033,581	3,866,600
2	7	Tier1資本に係る調整項目の額(△)	144,188	140,802
3		オン・バランス資産の額 (イ)	42,065,981	52,281,489
デリバティブ取引等に関する額				
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	592,011	650,735
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	923,564	903,876
		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	540,964	504,362
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(△)	187,311	169,673
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	71,009	74,034
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(△)	53,600	53,600
11	4	デリバティブ取引等に関する額 (ロ)	1,886,638	1,909,734
レポ取引等に関する額				
12		レポ取引等に関する資産の額	1,215,716	1,961,419
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	259,570	287,850
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)	1,475,286	2,249,270
オフ・バランス取引に関する額				
17		オフ・バランス取引の想定元本の額	8,185,111	7,426,754
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(△)	5,045,556	4,726,571
19	6	オフ・バランス取引に関する額 (ニ)	3,139,554	2,700,183
連結レバレッジ比率				
20		資本の額 (ホ)	2,426,251	2,420,402
21	8	総エクスポージャーの額((イ)+(ロ)+(ハ)+(ニ)) (ヘ)	48,567,460	59,140,679
22		連結レバレッジ比率((ホ)/(ヘ))	4.99%	4.09%
日本銀行に対する預け金を算入する場合の連結レバレッジ比率				
		総エクスポージャーの額 (ヘ)	48,567,460	
		日本銀行に対する預け金の額	12,138,513	
		日本銀行に対する預け金を算入する場合の総エクスポージャーの額 (ヘ')	60,705,974	
		日本銀行に対する預け金を算入する場合の連結レバレッジ比率((ホ)/(ヘ'))	3.99%	

前連結会計年度の連結レバレッジ比率との間に著しい差異が生じた原因(2021年3月期第1四半期)

2020年6月30日付告示(2019年金融庁告示第11号)改正においてレバレッジ比率の計算方法が変更され、日本銀行に対する預け金の額が総エクスポージャーから除外されたことにより、総エクスポージャーが著しく減少したものの