

単体レバレッジ比率の構成に関する事項(2024年3月期)

【三井住友信託銀行】

(単体・国際統一基準)

(単位:百万円)

項番 (国際様式(LR1) の該当番号)	項目	2024年 3月末	2023年 12月末
1	貸借対照表における総資産の額	73,338,642	
3	リスク移転の認識に係る要件を充足しない証券化エクスポージャーに係る調整	-	
4	中央銀行預け金に係る除外による調整(△)	20,284,622	
5	顧客資産のうち、貸借対照表上に計上されている金額(△)		
6	有価証券の売買を約定日基準により会計処理している場合における調整項目	-	
7	キャッシュ・プルーニング契約に基づく資金の移動に係る調整項目	-	
8	デリバティブ取引等に関する調整額	△ 1,520,398	
8a	デリバティブ取引等に関する額	1,693,649	
8b	デリバティブ取引等に関する資産の額(△)	3,214,048	
9	レポ取引等に関する調整額	155,465	
9a	レポ取引等に関する額	799,265	
9b	レポ取引等に関する額(△)	643,800	
10	オフ・バランス取引に関する額	3,565,589	
11	Tier1資本に係る調整項目の額(貸倒引当金)(△)	14,251	
12	その他の調整項目	△ 900,018	
12a	Tier1資本に係る調整項目の額(貸倒引当金以外)(△)	269,989	
12b	支払承諾見返勘定の額(△)	490,273	
12c	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(相殺した額に相当する部分に限る。)	-	
12d	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(△)	139,755	
13	総エクスポージャーの額	54,340,406	

(単位:百万円、%)

項番 (国際様式(LR2) の該当番号)	項目	2024年 3月末	2023年 12月末
オン・バランス資産の額(1)			
1	個別項目調整前のオン・バランス資産の額	48,705,897	
2	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(相殺した額に相当する部分に限る。)	-	
3	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(△)	139,755	
4	レポ取引等により受領した証券の計上額(△)	-	
5	Tier1資本に係る調整項目の額(貸倒引当金)(△)	14,251	
6	Tier1資本に係る調整項目の額(貸倒引当金以外)(△)	269,989	
7	オン・バランス資産の額 (イ)	48,281,902	
デリバティブ取引等に関する額(2)			
8	デリバティブ取引等に関するRCの額に1.4を乗じた額	552,053	
9	デリバティブ取引等に関するPFEの額に1.4を乗じた額	1,141,596	
10	間接清算参加者に適格中央清算機関の債務履行を保証していない場合に零とした中央清算機関向けエクスポージャーの額(△)	-	
11	クレジット・デリバティブ等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	19,600	
12	クレジット・デリバティブ等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(△)	19,600	
13	デリバティブ取引等に関する額 (ロ)	1,693,649	
レポ取引等に関する額(3)			
14	レポ取引等に関する資産の額	643,800	
15	レポ取引等に関する資産の額から控除した額(△)	-	
16	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	155,465	
17	代理取引のエクスポージャーの額		
18	レポ取引等に関する額 (ハ)	799,265	
オフ・バランス取引に関する額(4)			
19	オフ・バランス取引の想定元本の額	7,946,660	
20	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(△)	4,381,071	
22	オフ・バランス取引に関する額 (ニ)	3,565,589	
単体レバレッジ比率(5)			
23	資本の額 (ホ)	2,314,380	
24	総エクスポージャーの額((イ)+(ロ)+(ハ)+(ニ)) (ヘ)	54,340,406	
25	単体レバレッジ比率((ホ)/(ヘ))	4.25%	
26	適用する所要単体レバレッジ比率	3.00%	
日本銀行に対する預け金を算入する場合の単体レバレッジ比率(6)			
	総エクスポージャーの額 (ヘ)	54,340,406	
	日本銀行に対する預け金の額	20,284,622	
	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')	74,625,028	
	日本銀行に対する預け金を算入する場合の単体レバレッジ比率((ホ)/(ヘ'))	3.10%	
平均値の開示(7)			
28	レポ取引等に関する資産の額(控除後)に係る平均値((ト)+(チ))	658,450	
	レポ取引等に関する資産の額に係る平均値 (ト)	658,450	
	レポ取引等に関する資産の額から控除した額に係る平均値(チ)	-	
29	レポ取引等に関する資産の額(控除後)に係る四半期末の値((ウ)+(ヌ))	643,800	
14	レポ取引等に関する資産の額に係る四半期末の値 (ウ)	643,800	
15	レポ取引等に関する資産の額から控除した額に係る四半期末の値(ヌ)	-	
30	総エクスポージャーの額(レポ取引等に関する資産の額(控除後)に係る平均値を使用し、日本銀行に対する預け金を算入しない場合) (ル)	54,355,056	
30a	総エクスポージャーの額(レポ取引等に関する資産の額(控除後)に係る平均値を使用し、日本銀行に対する預け金を算入する場合) (ヲ)	74,639,678	
31	単体レバレッジ比率(レポ取引等に関する資産の額(控除後)に係る平均値を使用し、日本銀行に対する預け金を算入しない場合)((ホ)/(ル))	4.25%	
31a	単体レバレッジ比率(レポ取引等に関する資産の額(控除後)に係る平均値を使用し、日本銀行に対する預け金を算入する場合)((ホ)/(ヲ))	3.10%	

(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	2024年 3月末	2023年 12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		46,436,486
1a	1	貸借対照表における総資産の額		51,448,527
1b	3	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(△)		5,012,041
2	7	Tier1資本に係る調整項目の額(△)		285,575
3		オン・バランス資産の額 (イ)		46,150,910
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		904,965
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		1,272,581
		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		863,568
6		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		
		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(△)		45,563
8		清算会員である銀行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		18,600
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(△)		18,600
11	4	デリバティブ取引等に関する額 (ロ)		2,995,552
レボ取引等に関する額				
12		レボ取引等に関する資産の額		640,791
13		レボ取引等に関する資産の額から控除した額(△)		-
14		レボ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		254,089
15		代理取引のエクスポージャーの額		
16	5	レボ取引等に関する額 (ハ)		894,880
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		6,837,590
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(△)		3,270,942
19	6	オフ・バランス取引に関する額 (ニ)		3,566,648
単体レバレッジ比率				
20		資本の額 (ホ)		2,280,630
21	8	総エクスポージャーの額((イ)+(ロ)+(ハ)+(ニ)) (ヘ)		53,607,991
22		単体レバレッジ比率((ホ)/(ヘ))		4.25%
		適用する所要単体レバレッジ比率		3.00%
日本銀行に対する預け金を算入する場合の単体レバレッジ比率				
		総エクスポージャーの額 (ヘ)		53,607,991
		日本銀行に対する預け金の額		19,561,863
		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')		73,169,854
		日本銀行に対する預け金を算入する場合の単体レバレッジ比率((ホ)/(ヘ'))		3.11%