

持株レバレッジ比率の構成に関する事項(2024年3月期)

【三井住友トラスト・ホールディングス】

(連結・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	連結貸借対照表における総資産の額	75,876,905	
2	持株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(△)	-	
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、連結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・プーリ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	△ 1,509,056	
8a	デリバティブ取引等に関する額	1,710,785	
8b	デリバティブ取引等に関する資産の額(△)	3,219,841	
9	レボ取引等に関する調整額	184,754	
9a	レボ取引等に関する額	828,554	
9b	レボ取引等に関する額(△)	643,800	
10	オフ・バランス取引に関する額	3,495,287	
11	Tier1資本に係る調整項目の額(貸倒引当金)(△)	8,703	
12	その他の調整項目	△ 1,101,397	
12a	Tier1資本に係る調整項目の額(貸倒引当金以外)(△)	366,159	
12b	支払承諾見返勘定の額(△)	595,482	
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	
12e	持株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。)	-	
13	総エクスポージャーの額	56,653,167	

(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	51,133,158	
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)(△)	8,703	
6	Tier1資本に係る調整項目の額(貸倒引当金以外)(△)	366,159	
7	オン・バランス資産の額 (イ)	50,618,539	
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	554,773	
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	1,156,011	
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)	1,710,785	
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	184,754	
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)	828,554	
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	9,111,742	
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(△)	5,616,455	
22	オフ・バランス取引に関する額 (ニ)	3,495,287	
持株レバレッジ比率(5)			
23	資本の額 (ホ)	2,978,873	
24	総エクスポージャーの額((イ)+(ロ)+(ハ)+(ニ)) (ヘ)	56,653,167	
25	持株レバレッジ比率((ホ)/(ヘ))	5.25%	
26	適用する所要持株レバレッジ比率	3.00%	
27	適用する所要持株レバレッジ・バッファ比率	-%	
日本銀行に対する預け金を算入する場合の持株レバレッジ比率(6)			
	総エクスポージャーの額 (ヘ)	56,653,167	
	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')	76,937,789	
	日本銀行に対する預け金を算入する場合の持株レバレッジ比率((ホ)/(ヘ'))	3.87%	
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)	56,667,817	
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)	76,952,439	
31	持株レバレッジ比率(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))	5.25%	
31a	持株レバレッジ比率(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))	3.87%	

(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		48,664,850
1a	1	連結貸借対照表における総資産の額		53,786,308
1b	2	持株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	持株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(△)		5,121,458
2	7	Tier1資本に係る調整項目の額(△)		314,638
3		オン・バランス資産の額 (イ)		48,350,212
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		905,109
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		1,278,202
		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		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(△)		45,563
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		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)		3,001,317
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		255,684
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)		896,476
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		9,252,006
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(△)		5,480,496
19	6	オフ・バランス取引に関する額 (ニ)		3,771,510
持株レバレッジ比率				
20		資本の額 (ホ)		2,940,905
21	8	総エクスポージャーの額((イ)+(ロ)+(ハ)+(ニ)) (ヘ)		56,019,516
22		持株レバレッジ比率((ホ)/(ヘ))		5.24%
		適用する所要持株レバレッジ比率		3.00%
		適用する所要持株レバレッジ・バッファ率		-%
日本銀行に対する預け金を算入する場合の持株レバレッジ比率				
		総エクスポージャーの額 (ヘ)		56,019,516
		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')		75,581,379
		日本銀行に対する預け金を算入する場合の持株レバレッジ比率((ホ)/(ヘ'))		3.89%