

## 資料編 〈パーゼルⅢ関連データ〉

### 三井住友信託銀行

銀行法施行規則（昭和57年大蔵省令第10号）第19条の2第1項第5号二等の規定に基づき、自己資本の充実の状況等について金融庁長官が別に定める事項（平成26年金融庁告示第7号）及び銀行法施行規則第19条の2第1項第5号ホ等の規定に基づき、流動性に係る経営の健全性の状況について金融庁長官が別に定める事項（平成27年金融庁告示第7号）として、中間事業年度に係る説明書類に記載すべき事項を記載・開示しております。

#### 【定量的な開示事項：三井住友信託銀行】

| 連結                                          |     | 単体                                        |     |
|---------------------------------------------|-----|-------------------------------------------|-----|
| KM1: 主要な指標                                  | 188 | KM1: 主要な指標                                | 246 |
| 自己資本比率に関する事項                                | 189 | 自己資本の構成に関する開示事項                           | 247 |
| 連結の範囲に関する事項                                 | 189 | 貸借対照表の科目が自己資本の構成に関する開示項目のいずれに相当するかについての説明 | 250 |
| 自己資本の構成に関する開示事項                             | 190 | 別紙様式による開示事項                               | 260 |
| 自己資本調達手段に関する契約内容の概要・詳細                      | 193 | 単体レバレッジ比率に関する開示事項                         | 262 |
| 連結貸借対照表の科目が自己資本の構成に関する開示項目のいずれに相当するかについての説明 | 193 | 単体流動性力バレッジ比率に関する開示事項                      | 263 |
| リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算に関する事項      | 205 |                                           |     |
| 別紙様式による開示事項                                 | 206 |                                           |     |
| 連結レバレッジ比率に関する開示事項                           | 244 |                                           |     |
| 連結流動性力バレッジ比率に関する開示事項                        | 245 |                                           |     |

## KM1：主要な指標

(単位：百万円、%)

| KM1           |                |              |              |              |               |              |
|---------------|----------------|--------------|--------------|--------------|---------------|--------------|
| 国際様式の<br>該当番号 |                | イ            | ロ            | ハ            | ニ             | ホ            |
|               |                | 2020年<br>9月末 | 2020年<br>6月末 | 2020年<br>3月末 | 2019年<br>12月末 | 2019年<br>9月末 |
| 資本            |                |              |              |              |               |              |
| 1             | 普通株式等Tier1資本の額 | 2,103,605    | 2,074,917    | 2,068,648    | 2,126,088     | 2,115,555    |
| 2             | Tier1資本の額      | 2,454,860    | 2,426,251    | 2,420,402    | 2,477,180     | 2,466,947    |
| 3             | 総自己資本の額        | 3,001,120    | 2,937,960    | 2,944,968    | 2,997,793     | 2,989,248    |
| リスク・アセット      |                |              |              |              |               |              |
| 4             | リスク・アセットの額     | 19,281,057   | 19,119,407   | 18,657,616   | 19,363,782    | 18,667,159   |
| 自己資本比率        |                |              |              |              |               |              |
| 5             | 連結普通株式等Tier1比率 | 10.91%       | 10.85%       | 11.08%       | 10.97%        | 11.33%       |
| 6             | 連結Tier1比率      | 12.73%       | 12.68%       | 12.97%       | 12.79%        | 13.21%       |
| 7             | 連結総自己資本比率      | 15.56%       | 15.36%       | 15.78%       | 15.48%        | 16.01%       |
| 連結レバレッジ比率     |                |              |              |              |               |              |
| 13            | 総エクスポージャーの額    | 47,662,176   | 48,567,460   | 59,140,679   | 57,940,472    | 59,946,397   |
| 14            | 連結レバレッジ比率      | 5.15%        | 4.99%        | 4.09%        | 4.27%         | 4.11%        |

(単位：百万円、%)

| KM1           |                 |                 |                 |                 |                 |                 |
|---------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| 国際様式の<br>該当番号 |                 | イ               | ロ               | ハ               | ニ               | ホ               |
|               |                 | 2020年度<br>第2四半期 | 2020年度<br>第1四半期 | 2019年度<br>第4四半期 | 2019年度<br>第3四半期 | 2019年度<br>第2四半期 |
| 連結流動性カバレッジ比率  |                 |                 |                 |                 |                 |                 |
| 15            | 算入可能適格流動性資産の合計額 | 17,953,290      | 13,694,560      | 14,412,361      | 15,227,585      | 15,446,412      |
| 16            | 純資金流出額          | 11,002,119      | 11,367,890      | 11,278,102      | 11,969,705      | 11,584,160      |
| 17            | 連結流動性カバレッジ比率    | 163.1%          | 120.4%          | 127.7%          | 127.2%          | 133.3%          |

(注) 1. 2019年度第2四半期においては日次データを用いるべき項目の一部を月末データで代用し算出しております。

## 自己資本比率に関する事項

自己資本比率は、「銀行法第14条の2の規定に基づき、銀行がその保有する資産等に照らし自己資本の充実の状況が適当であるかどうかを判断するための基準」（平成18年金融庁告示第19号。以下、「銀行告示」という。）に定められた算式に基づいて、連結ベースと単体ベースの双方について算出しております。

2020年9月末において、当社は、国際統一基準を適用の上、信用リスク・アセットの算出においては先進的内部格付手法、オペレーショナル・リスク相当額の算出においては先進的計測手法を採用するとともに、マーケット・リスク規制を導入しております。

## 連結の範囲に関する事項

(1) 銀行告示第3条に定める連結自己資本比率を算出する対象となる会社の集団（以下、「連結グループ」という。）に属する会社と会計連結範囲に含まれる会社との相違点はございません。

(2) 連結グループに属する連結子会社は39社であります。主要な会社は次の通りであります。

| 名 称                                         | 主要な業務の内容                  |
|---------------------------------------------|---------------------------|
| 三井住友トラスト・パナソニックファイナンス株式会社                   | 総合リース業務、割賦販売業務、クレジットカード業務 |
| 三井住友トラストクラブ株式会社                             | クレジットカード業務                |
| 三井住友トラスト不動産株式会社                             | 不動産仲介業務                   |
| 三井住友トラスト・ローン＆ファイナンス株式会社                     | 金銭の貸付業務                   |
| Sumitomo Mitsui Trust Bank (U.S.A.) Limited | 銀行業務、信託業務                 |

(3) 銀行告示第9条が適用される金融業務を営む関連法人等はありません。

(4) 連結グループ内の資金および自己資本の移動に係る制限等は特段ございません。

(5) その他金融機関等であって子法人等であるもののうち、自己資本比率規制上の所要自己資本を下回った会社はございません。

## 自己資本の構成に関する開示事項（連結自己資本比率）

## CC1：自己資本の構成

（単位：百万円、％）

| CC1                 |                                                |           |           |                            |
|---------------------|------------------------------------------------|-----------|-----------|----------------------------|
| 国際様式の<br>該当番号       | 項 目                                            | イ         | ロ         | ハ                          |
|                     |                                                | 2020年9月末  | 2019年9月末  | 別紙様式<br>第十四号（CC2）の<br>参照項目 |
| 普通株式等Tier1資本に係る基礎項目 |                                                |           |           |                            |
| 1a+2-1c-26          | 普通株式に係る株主資本の額                                  | 1,972,406 | 1,898,459 |                            |
| 1a                  | うち、資本金及び資本剰余金の額                                | 684,890   | 684,890   |                            |
| 2                   | うち、利益剰余金の額                                     | 1,315,648 | 1,270,838 |                            |
| 1c                  | うち、自己株式の額（△）                                   | －         | －         |                            |
| 26                  | うち、社外流出予定額（△）                                  | 28,132    | 57,269    |                            |
|                     | うち、上記以外に該当するものの額                               | －         | －         |                            |
| 1b                  | 普通株式に係る新株予約権の額                                 | －         | －         |                            |
| 3                   | その他の包括利益累計額及びその他公表準備金の額                        | 229,860   | 379,878   | (a)                        |
| 5                   | 普通株式等Tier1資本に係る調整後非支配株主持分の額                    | －         | －         |                            |
| 6                   | 普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額（イ）                       | 2,202,267 | 2,278,337 |                            |
| 普通株式等Tier1資本に係る調整項目 |                                                |           |           |                            |
| 8+9                 | 無形固定資産（モーゲージ・サービシング・ライツに係るものを除く。）の額の合計額        | 77,442    | 98,327    |                            |
| 8                   | うち、のれんに係るもの（のれん相当差額を含む。）の額                     | 21,017    | 34,836    |                            |
| 9                   | うち、のれん及びモーゲージ・サービシング・ライツに係るもの以外のものの額           | 56,424    | 63,490    |                            |
| 10                  | 繰延税金資産（一時差異に係るものを除く。）の額                        | 168       | 443       |                            |
| 11                  | 繰延ヘッジ損益の額                                      | △ 48,401  | △ 41,746  |                            |
| 12                  | 適格引当金不足額                                       | －         | 342       |                            |
| 13                  | 証券化取引に伴い増加した自己資本に相当する額                         | 1,060     | 1,204     |                            |
| 14                  | 負債の時価評価により生じた時価評価差額であって自己資本に算入される額             | －         | －         |                            |
| 15                  | 退職給付に係る資産の額                                    | 68,391    | 104,210   |                            |
| 16                  | 自己保有普通株式（純資産の部に計上されるものを除く。）の額                  | －         | －         |                            |
| 17                  | 意図的に保有している他の金融機関等の普通株式の額                       | －         | －         |                            |
| 18                  | 少数出資金融機関等の普通株式の額                               | －         | －         |                            |
| 19+20+21            | 特定項目に係る十パーセント基準超過額                             | －         | －         |                            |
| 19                  | うち、その他金融機関等に係る対象資本等調達手段のうち普通株式に該当するものに関連するものの額 | －         | －         |                            |
| 20                  | うち、無形固定資産（モーゲージ・サービシング・ライツに係るものに限る。）に関連するものの額  | －         | －         |                            |
| 21                  | うち、繰延税金資産（一時差異に係るものに限る。）に関連するものの額              | －         | －         |                            |
| 22                  | 特定項目に係る十五パーセント基準超過額                            | －         | －         |                            |
| 23                  | うち、その他金融機関等に係る対象資本等調達手段のうち普通株式に該当するものに関連するものの額 | －         | －         |                            |
| 24                  | うち、無形固定資産（モーゲージ・サービシング・ライツに係るものに限る。）に関連するものの額  | －         | －         |                            |
| 25                  | うち、繰延税金資産（一時差異に係るものに限る。）に関連するものの額              | －         | －         |                            |
| 27                  | その他Tier1資本不足額                                  | －         | －         |                            |
| 28                  | 普通株式等Tier1資本に係る調整項目の額（ロ）                       | 98,661    | 162,782   |                            |
| 普通株式等Tier1資本        |                                                |           |           |                            |
| 29                  | 普通株式等Tier1資本の額（（イ）－（ロ））（ハ）                     | 2,103,605 | 2,115,555 |                            |

(単位：百万円、%)

| CC1               |     |                                              |           |           |                            |
|-------------------|-----|----------------------------------------------|-----------|-----------|----------------------------|
| 国際様式の<br>該当番号     |     | 項 目                                          | イ         | ロ         | ハ                          |
|                   |     |                                              | 2020年9月末  | 2019年9月末  | 別紙様式<br>第十四号（CC2）の<br>参照項目 |
| その他Tier1資本に係る基礎項目 |     |                                              |           |           |                            |
| 30                | 31a | その他Tier1資本調達手段に係る株主資本の額                      | －         | －         |                            |
|                   | 31b | その他Tier1資本調達手段に係る新株予約権の額                     | －         | －         |                            |
|                   | 32  | その他Tier1資本調達手段に係る負債の額                        | 340,000   | 340,000   |                            |
|                   |     | 特別目的会社等の発行するその他Tier1資本調達手段の額                 | －         | －         |                            |
| 34－35             |     | その他Tier1資本に係る調整後非支配株主持分等の額                   | 11,255    | 11,391    |                            |
| 33＋35             |     | 適格旧Tier1資本調達手段の額のうちその他Tier1資本に係る基礎項目の額に含まれる額 | －         | －         |                            |
| 33                |     | うち、銀行及び銀行の特別目的会社等の発行する資本調達手段の額               | －         | －         |                            |
| 35                |     | うち、銀行の連結子法人等（銀行の特別目的会社等を除く。）の発行する資本調達手段の額    | －         | －         |                            |
| 36                |     | その他Tier1資本に係る基礎項目の額（二）                       | 351,255   | 351,391   |                            |
| その他Tier1資本に係る調整項目 |     |                                              |           |           |                            |
| 37                |     | 自己保有その他Tier1資本調達手段の額                         | －         | －         |                            |
| 38                |     | 意図的に保有している他の金融機関等のその他Tier1資本調達手段の額           | －         | －         |                            |
| 39                |     | 少数出資金融機関等のその他Tier1資本調達手段の額                   | －         | －         |                            |
| 40                |     | その他金融機関等のその他Tier1資本調達手段の額                    | －         | －         |                            |
| 42                |     | Tier2資本不足額                                   | －         | －         |                            |
| 43                |     | その他Tier1資本に係る調整項目の額（ホ）                       | －         | －         |                            |
| その他Tier1資本        |     |                                              |           |           |                            |
| 44                |     | その他Tier1資本の額（（二）－（ホ））（ヘ）                     | 351,255   | 351,391   |                            |
| Tier1資本           |     |                                              |           |           |                            |
| 45                |     | Tier1資本の額（（ハ）＋（ヘ））（ト）                        | 2,454,860 | 2,466,947 |                            |
| Tier2資本に係る基礎項目    |     |                                              |           |           |                            |
| 46                |     | Tier2資本調達手段に係る株主資本の額                         | －         | －         |                            |
|                   |     | Tier2資本調達手段に係る新株予約権の額                        | －         | －         |                            |
|                   |     | Tier2資本調達手段に係る負債の額                           | 341,657   | 309,589   |                            |
|                   |     | 特別目的会社等の発行するTier2資本調達手段の額                    | －         | －         |                            |
| 48－49             |     | Tier2資本に係る調整後非支配株主持分等の額                      | 2,013     | 2,343     |                            |
| 47＋49             |     | 適格旧Tier2資本調達手段の額のうちTier2資本に係る基礎項目の額に含まれる額    | 170,648   | 209,227   |                            |
| 47                |     | うち、銀行及び銀行の特別目的会社等の発行する資本調達手段の額               | 170,648   | 209,227   |                            |
| 49                |     | うち、銀行の連結子法人等（銀行の特別目的会社等を除く。）の発行する資本調達手段の額    | －         | －         |                            |
| 50                |     | 一般貸倒引当金Tier2算入額及び適格引当金Tier2算入額の合計額           | 33,480    | 2,680     |                            |
| 50a               |     | うち、一般貸倒引当金Tier2算入額                           | 3,031     | 2,680     |                            |
| 50b               |     | うち、適格引当金Tier2算入額                             | 30,448    | －         |                            |
| 51                |     | Tier2資本に係る基礎項目の額（チ）                          | 547,799   | 523,840   |                            |

三井住友トラスト・ホールディングス  
決算データ三井住友信託銀行  
決算データ三井住友トラスト・ホールディングス  
パーゼル川関連データ三井住友信託銀行  
パーゼル川関連データ

開示項目一覧

(単位：百万円、%)

| CC1                             |                                                                                                              |            |            |                            |
|---------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------|------------|----------------------------|
| 国際様式の<br>該当番号                   | 項 目                                                                                                          | イ          | ロ          | ハ                          |
|                                 |                                                                                                              | 2020年9月末   | 2019年9月末   | 別紙様式<br>第十四号（CC2）の<br>参照項目 |
| Tier2資本に係る調整項目                  |                                                                                                              |            |            |                            |
| 52                              | 自己保有Tier2資本調達手段の額                                                                                            | —          | —          |                            |
| 53                              | 意図的に保有している他の金融機関等のTier2資本調達手段及び<br>その他外部TLAC関連調達手段の額                                                         | —          | —          |                            |
| 54                              | 少数出資金融機関等のTier2資本調達手段及びその他外部<br>TLAC関連調達手段の額                                                                 | —          | —          |                            |
| 55                              | その他金融機関等のTier2資本調達手段及びその他外部TLAC<br>関連調達手段の額                                                                  | 1,540      | 1,540      |                            |
| 57                              | Tier2資本に係る調整項目の額（リ）                                                                                          | 1,540      | 1,540      |                            |
| Tier2資本                         |                                                                                                              |            |            |                            |
| 58                              | Tier2資本の額（（チ）－（リ））（ヌ）                                                                                        | 546,259    | 522,300    |                            |
| 総自己資本                           |                                                                                                              |            |            |                            |
| 59                              | 総自己資本の額（（ト）＋（ヌ））（ル）                                                                                          | 3,001,120  | 2,989,248  |                            |
| リスク・アセット                        |                                                                                                              |            |            |                            |
| 60                              | リスク・アセットの額の合計額（ヲ）                                                                                            | 19,281,057 | 18,667,159 |                            |
| 連結自己資本比率                        |                                                                                                              |            |            |                            |
| 61                              | 連結普通株式等Tier1比率（（ハ）／（ヲ））                                                                                      | 10.91%     | 11.33%     |                            |
| 62                              | 連結Tier1比率（（ト）／（ヲ））                                                                                           | 12.73%     | 13.21%     |                            |
| 63                              | 連結総自己資本比率（（ル）／（ヲ））                                                                                           | 15.56%     | 16.01%     |                            |
| 調整項目に係る参考事項                     |                                                                                                              |            |            |                            |
| 72                              | 少数出資金融機関等の対象資本等調達手段に係る調整項目不<br>算入額                                                                           | 113,457    | 121,383    |                            |
| 73                              | その他金融機関等に係る対象資本等調達手段のうち普通株式<br>に係る調整項目不算入額                                                                   | 106,380    | 98,003     |                            |
| 74                              | 無形固定資産（モーゲージ・サービシング・ライツに係るも<br>のに限る。）に係る調整項目不算入額                                                             | —          | —          |                            |
| 75                              | 繰延税金資産（一時差異に係るものに限る。）に係る調整項目<br>不算入額                                                                         | 16,679     | —          |                            |
| Tier2資本に係る基礎項目の額に算入される引当金に関する事項 |                                                                                                              |            |            |                            |
| 76                              | 一般貸倒引当金の額                                                                                                    | 3,031      | 2,680      |                            |
| 77                              | 一般貸倒引当金に係るTier2資本算入上限額                                                                                       | 8,412      | 7,368      |                            |
| 78                              | 内部格付手法採用行において、適格引当金の合計額から事業<br>法人等向けエクスポージャー及びリテール向けエクスポー<br>ジャーの期待損失額の合計額を控除した額（当該額が零を下回<br>る場合にあっては、零とする。） | 30,448     | —          |                            |
| 79                              | 適格引当金に係るTier2資本算入上限額                                                                                         | 94,131     | 93,238     |                            |
| 資本調達手段に係る経過措置に関する事項             |                                                                                                              |            |            |                            |
| 82                              | 適格旧Tier1資本調達手段に係る算入上限額                                                                                       | 77,800     | 116,700    |                            |
| 83                              | 適格旧Tier1資本調達手段の額から適格旧Tier1資本調達手段に<br>係る算入上限額を控除した額（当該額が零を下回る場合に<br>あっては、零とする。）                               | —          | —          |                            |
| 84                              | 適格旧Tier2資本調達手段に係る算入上限額                                                                                       | 171,581    | 257,372    |                            |
| 85                              | 適格旧Tier2資本調達手段の額から適格旧Tier2資本調達手段に<br>係る算入上限額を控除した額（当該額が零を下回る場合に<br>あっては、零とする。）                               | —          | —          |                            |

(注) 1. 当社は連結自己資本比率の算定に関し、「自己資本比率及びレバレッジ比率の算定に対する合意された手続業務に関する実務指針」（日本公認会計士協会専門業務実務指針 4465 令和元年8月27日）に基づく外部監査を有限責任 監査法人より受けております。  
当該外部監査は連結財務諸表の監査又は財務報告に係る内部統制の監査の一部ではなく、当社と合意した範囲及び手続により外部監査人が実施し、その結果を当社宛に報告するものであります。外部監査人が連結自己資本比率そのものや連結自己資本比率の算定に係る内部統制について意見又は結論を表明するものではありません。

## 自己資本調達手段に関する契約内容の概要・詳細

自己資本調達手段に関する契約内容の概要・詳細は、当社ホームページ（<https://www.smth.jp/ir/basel/index.html>）に掲載しております。

## 連結貸借対照表の科目が自己資本の構成に関する開示項目のいずれに相当するかについての説明

2020年9月末

CC2：連結貸借対照表の科目と自己資本の構成に関する開示項目の対応関係

(単位：百万円)

| 項目             | イ             | ハ                          | ニ          |
|----------------|---------------|----------------------------|------------|
|                | 公表<br>連結貸借対照表 | 別紙様式<br>第五号を参照する<br>番号又は記号 | 付表<br>参照番号 |
| (資産の部)         |               |                            |            |
| 現金預け金          | 17,445,206    |                            |            |
| コールローン及び買入手形   | 21,818        |                            |            |
| 買現先勘定          | 145,010       |                            |            |
| 債券貸借取引支払保証金    | 779,616       |                            |            |
| 買入金銭債権         | 760,573       |                            |            |
| 特定取引資産         | 462,094       |                            |            |
| 金銭の信託          | 1,343         |                            |            |
| 有価証券           | 6,641,471     |                            | 2-b、6-a    |
| 貸出金            | 30,140,335    |                            | 6-b        |
| 外国為替           | 46,173        |                            |            |
| リース債権及びリース投資資産 | 666,424       |                            |            |
| その他資産          | 1,679,190     |                            | 6-c        |
| 有形固定資産         | 220,156       |                            |            |
| 無形固定資産         | 100,545       |                            | 2-a        |
| 退職給付に係る資産      | 98,594        |                            | 3          |
| 繰延税金資産         | 28,304        |                            | 4-a        |
| 支払承諾見返         | 520,768       |                            |            |
| 貸倒引当金          | △ 124,896     |                            |            |
| 資産の部合計         | 59,632,732    |                            |            |

(単位：百万円)

| CC2           |               |                            |            |
|---------------|---------------|----------------------------|------------|
| 項 目           | イ             | ハ                          | ニ          |
|               | 公表<br>連結貸借対照表 | 別紙様式<br>第五号を参照する<br>番号又は記号 | 付表<br>参照番号 |
| (負債の部)        |               |                            |            |
| 預金            | 34,100,465    |                            |            |
| 譲渡性預金         | 7,117,204     |                            |            |
| コールマネー及び売渡手形  | 24,348        |                            |            |
| 売現先勘定         | 1,379,058     |                            |            |
| 特定取引負債        | 325,463       |                            |            |
| 借入金           | 6,231,590     |                            | 8          |
| 外国為替          | 1,866         |                            |            |
| 短期社債          | 2,532,452     |                            |            |
| 社債            | 597,082       |                            |            |
| 信託勘定借         | 3,517,414     |                            |            |
| その他負債         | 914,733       |                            | 6-d        |
| 賞与引当金         | 11,031        |                            |            |
| 役員賞与引当金       | —             |                            |            |
| 株式給付引当金       | 302           |                            |            |
| 退職給付に係る負債     | 12,116        |                            |            |
| ポイント引当金       | 16,707        |                            |            |
| 睡眠預金払戻損失引当金   | 4,415         |                            |            |
| 偶発損失引当金       | 1,455         |                            |            |
| 繰延税金負債        | 64,293        |                            | 4-b        |
| 再評価に係る繰延税金負債  | 2,439         |                            | 4-c        |
| 支払承諾          | 520,768       |                            |            |
| 負債の部合計        | 57,375,211    |                            |            |
| (純資産の部)       |               |                            |            |
| 資本金           | 342,037       |                            | 1-a        |
| 資本剰余金         | 342,853       |                            | 1-b        |
| 利益剰余金         | 1,315,648     |                            | 1-c        |
| 株主資本合計        | 2,000,539     |                            |            |
| その他有価証券評価差額金  | 360,751       |                            |            |
| 繰延ヘッジ損益       | △ 58,318      |                            | 5          |
| 土地再評価差額金      | △ 3,901       |                            |            |
| 為替換算調整勘定      | △ 3,527       |                            |            |
| 退職給付に係る調整累計額  | △ 65,143      |                            |            |
| その他の包括利益累計額合計 | 229,860       | (a)                        |            |
| 非支配株主持分       | 27,120        |                            | 7          |
| 純資産の部合計       | 2,257,520     |                            |            |
| 負債及び純資産の部合計   | 59,632,732    |                            |            |

(注) 1. 規制上の連結の範囲と会計上の連結の範囲は同一であります。

## (付表)

(注) 本表の「自己資本の構成に関する開示項目」の金額については、経過措置により自己資本に算入されている項目については含んでおりません。

## 1. 株主資本

## (1) 連結貸借対照表

(単位：百万円)

| 連結貸借対照表科目 | 金額        | 備考 | 参照番号 |
|-----------|-----------|----|------|
| 資本金       | 342,037   |    | 1-a  |
| 資本剰余金     | 342,853   |    | 1-b  |
| 利益剰余金     | 1,315,648 |    | 1-c  |
| 株主資本合計    | 2,000,539 |    |      |

## (2) 自己資本の構成

(単位：百万円)

| 自己資本の構成に関する開示項目    | 金額        | 備考                        | 国際様式の該当番号 |
|--------------------|-----------|---------------------------|-----------|
| 普通株式等Tier1資本に係る額   | 2,000,539 | 普通株式に係る株主資本（社外流出予定額調整前）   |           |
| うち、資本金及び資本剰余金の額    | 684,890   |                           | 1a        |
| うち、利益剰余金の額         | 1,315,648 |                           | 2         |
| うち、自己株式の額（△）       | —         |                           | 1c        |
| うち、上記以外に該当するものの額   | —         |                           |           |
| その他Tier1資本調達手段に係る額 | —         | 実質破綻時損失吸収条項のある優先株式に係る株主資本 | 31a       |

## 2. 無形固定資産

## (1) 連結貸借対照表

(単位：百万円)

| 連結貸借対照表科目           | 金額        | 備考 | 参照番号 |
|---------------------|-----------|----|------|
| 無形固定資産              | 100,545   |    | 2-a  |
| 有価証券                | 6,641,471 |    | 2-b  |
| うち、持分法適用会社に係るのれん相当額 | 1,940     |    |      |

|          |        |  |  |
|----------|--------|--|--|
| 上記に係る税効果 | 25,044 |  |  |
|----------|--------|--|--|

## (2) 自己資本の構成

(単位：百万円)

| 自己資本の構成に関する開示項目                              | 金額     | 備考                              | 国際様式の該当番号 |
|----------------------------------------------|--------|---------------------------------|-----------|
| 無形固定資産 のれんに係るもの                              | 21,017 |                                 | 8         |
| 無形固定資産 その他の無形固定資産                            | 56,424 | のれん、モーゲージ・サービシング・ライツ以外（ソフトウェア等） | 9         |
| 無形固定資産 モーゲージ・サービシング・ライツ                      | —      |                                 |           |
| 特定項目に係る十パーセント基準超過額                           | —      |                                 | 20        |
| 特定項目に係る十五パーセント基準超過額                          | —      |                                 | 24        |
| 無形固定資産（モーゲージ・サービシング・ライツに係るものに限り。）に係る調整項目不算入額 | —      |                                 | 74        |

## 3. 退職給付に係る資産

## (1) 連結貸借対照表

(単位：百万円)

| 連結貸借対照表科目 | 金額     | 備考 | 参照番号 |
|-----------|--------|----|------|
| 退職給付に係る資産 | 98,594 |    | 3    |

## 上記に係る税効果

30,202

## (2) 自己資本の構成

(単位：百万円)

| 自己資本の構成に関する開示項目 | 金額     | 備考 | 国際様式の<br>該当番号 |
|-----------------|--------|----|---------------|
| 退職給付に係る資産の額     | 68,391 |    | 15            |

## 4. 繰延税金資産

## (1) 連結貸借対照表

(単位：百万円)

| 連結貸借対照表科目    | 金額     | 備考 | 参照番号 |
|--------------|--------|----|------|
| 繰延税金資産       | 28,304 |    | 4-a  |
| 繰延税金負債       | 64,293 |    | 4-b  |
| 再評価に係る繰延税金負債 | 2,439  |    | 4-c  |

## その他の無形固定資産の税効果勘案分

25,044

## 退職給付に係る資産の額の税効果勘案分

30,202

## (2) 自己資本の構成

(単位：百万円)

| 自己資本の構成に関する開示項目                  | 金額     | 備考                           | 国際様式の<br>該当番号 |
|----------------------------------|--------|------------------------------|---------------|
| 繰延税金資産（一時差異に係るものを除く。）            | 168    | 資産負債相殺処理のため、連結貸借対照表計上額とは一致せず | 10            |
| 一時差異に係る繰延税金資産                    | 16,679 | 資産負債相殺処理のため、連結貸借対照表計上額とは一致せず |               |
| 特定項目に係る十パーセント基準超過額               | —      |                              | 21            |
| 特定項目に係る十五パーセント基準超過額              | —      |                              | 25            |
| 繰延税金資産（一時差異に係るものに限る。）に係る調整項目不算入額 | 16,679 |                              | 75            |

## 5. 繰延ヘッジ損益

## (1) 連結貸借対照表

(単位：百万円)

| 連結貸借対照表科目 | 金額       | 備考 | 参照番号 |
|-----------|----------|----|------|
| 繰延ヘッジ損益   | △ 58,318 |    | 5    |

## (2) 自己資本の構成

(単位：百万円)

| 自己資本の構成に関する開示項目 | 金額       | 備考                                             | 国際様式の<br>該当番号 |
|-----------------|----------|------------------------------------------------|---------------|
| 繰延ヘッジ損益の額       | △ 48,401 | ヘッジ対象に係る時価評価差額が「その他の包括利益累計額」として計上されているものを除いたもの | 11            |

## 6. 金融機関向け出資等

## (1) 連結貸借対照表

(単位：百万円)

| 連結貸借対照表科目 | 金額         | 備考         | 参照番号 |
|-----------|------------|------------|------|
| 有価証券      | 6,641,471  |            | 6-a  |
| 貸出金       | 30,140,335 | 劣後債務等を含む   | 6-b  |
| その他資産     | 1,679,190  | 金融派生商品等を含む | 6-c  |
| その他負債     | 914,733    | 金融派生商品等を含む | 6-d  |

## (2) 自己資本の構成

(単位：百万円)

| 自己資本の構成に関する開示項目                            | 金額      | 備考 | 国際様式の<br>該当番号 |
|--------------------------------------------|---------|----|---------------|
| 自己保有資本調達手段の額                               | —       |    |               |
| 普通株式等Tier1相当額                              | —       |    | 16            |
| その他Tier1相当額                                | —       |    | 37            |
| Tier2相当額                                   | —       |    | 52            |
| 意図的に保有している他の金融機関等の資本等調達手段の額                | —       |    |               |
| 普通株式等Tier1相当額                              | —       |    | 17            |
| その他Tier1相当額                                | —       |    | 38            |
| Tier2相当額およびその他外部TLAC関連相当額                  | —       |    | 53            |
| 少数出資金融機関等の資本等調達手段の額                        | 113,457 |    |               |
| 普通株式等Tier1相当額                              | —       |    | 18            |
| その他Tier1相当額                                | —       |    | 39            |
| Tier2相当額およびその他外部TLAC関連相当額                  | —       |    | 54            |
| 少数出資金融機関等の対象資本等調達手段に係る調整<br>項目不算入額         | 113,457 |    | 72            |
| その他金融機関等（10%超出資）に係る資本等調達手段の額               | 107,920 |    |               |
| 特定項目に係る十パーセント基準超過額                         | —       |    | 19            |
| 特定項目に係る十五パーセント基準超過額                        | —       |    | 23            |
| その他Tier1相当額                                | —       |    | 40            |
| Tier2相当額およびその他外部TLAC関連相当額                  | 1,540   |    | 55            |
| その他金融機関等に係る対象資本等調達手段のうち普通<br>株式に係る調整項目不算入額 | 106,380 |    | 73            |

## 7. 非支配株主持分

## (1) 連結貸借対照表

(単位：百万円)

| 連結貸借対照表科目 | 金額     | 備考 | 参照番号 |
|-----------|--------|----|------|
| 非支配株主持分   | 27,120 |    | 7    |

## (2) 自己資本の構成

(単位：百万円)

| 自己資本の構成に関する開示項目              | 金額     | 備考                       | 国際様式の<br>該当番号 |
|------------------------------|--------|--------------------------|---------------|
| 普通株式等Tier1資本に係る額             | —      | 算入可能額（調整後非支配株主持分）<br>勘案後 | 5             |
| 特別目的会社等の発行するその他Tier1資本調達手段の額 | —      |                          | 30-31ab-32    |
| その他Tier1資本に係る額               | 11,255 | 算入可能額（調整後非支配株主持分）<br>勘案後 | 34-35         |
| 特別目的会社等の発行するTier2資本調達手段の額    | —      |                          | 46            |
| Tier2資本に係る額                  | 2,013  | 算入可能額（調整後非支配株主持分）<br>勘案後 | 48-49         |

## 8. その他資本調達

## (1) 連結貸借対照表

(単位：百万円)

| 連結貸借対照表科目 | 金額        | 備考 | 参照番号 |
|-----------|-----------|----|------|
| 借入金       | 6,231,590 |    | 8    |

## (2) 自己資本の構成

(単位：百万円)

| 自己資本の構成に関する開示項目       | 金額      | 備考 | 国際様式の<br>該当番号 |
|-----------------------|---------|----|---------------|
| その他Tier1資本調達手段に係る負債の額 | 340,000 |    | 32            |
| Tier2資本調達手段に係る負債の額    | 341,657 |    | 46            |

2019年9月末

(単位：百万円)

| CC2            |               |                            |            |
|----------------|---------------|----------------------------|------------|
| 項 目            | イ             | ハ                          | ニ          |
|                | 公表<br>連結貸借対照表 | 別紙様式<br>第五号を参照する<br>番号又は記号 | 付表<br>参照番号 |
| (資産の部)         |               |                            |            |
| 現金預け金          | 16,099,942    |                            |            |
| コールローン及び買入手形   | 52,764        |                            |            |
| 買現先勘定          | 159,139       |                            |            |
| 債券貸借取引支払保証金    | 741,350       |                            |            |
| 買入金銭債権         | 842,152       |                            |            |
| 特定取引資産         | 429,529       |                            |            |
| 金銭の信託          | 1,369         |                            |            |
| 有価証券           | 6,060,402     |                            | 2-b、6-a    |
| 貸出金            | 29,083,657    |                            | 6-b        |
| 外国為替           | 32,155        |                            |            |
| リース債権及びリース投資資産 | 668,042       |                            |            |
| その他資産          | 1,709,683     |                            | 6-c        |
| 有形固定資産         | 223,182       |                            |            |
| 無形固定資産         | 120,607       |                            | 2-a        |
| 退職給付に係る資産      | 150,219       |                            | 3          |
| 繰延税金資産         | 28,654        |                            | 4-a        |
| 支払承諾見返         | 584,926       |                            |            |
| 貸倒引当金          | △ 89,269      |                            |            |
| 資産の部合計         | 56,898,511    |                            |            |

三井住友トラスト・ホールディングス  
決算データ三井住友信託銀行  
決算データ三井住友トラスト・ホールディングス  
パーゼル川関連データ三井住友信託銀行  
パーゼル川関連データ

開示項目一覧

(単位：百万円)

| CC2           |               |                            |            |
|---------------|---------------|----------------------------|------------|
| 項 目           | イ             | ハ                          | ニ          |
|               | 公表<br>連結貸借対照表 | 別紙様式<br>第五号を参照する<br>番号又は記号 | 付表<br>参照番号 |
| (負債の部)        |               |                            |            |
| 預金            | 30,752,574    |                            |            |
| 譲渡性預金         | 7,018,616     |                            |            |
| コールマネー及び売渡手形  | 1,857,320     |                            |            |
| 売現先勘定         | 1,636,623     |                            |            |
| 債券貸借取引受入担保金   | 141,156       |                            |            |
| 特定取引負債        | 304,382       |                            |            |
| 借入金           | 4,710,891     |                            | 8          |
| 外国為替          | 347           |                            |            |
| 短期社債          | 1,878,062     |                            |            |
| 社債            | 592,681       |                            |            |
| 信託勘定借         | 3,965,260     |                            |            |
| その他負債         | 905,893       |                            | 6-d        |
| 賞与引当金         | 11,427        |                            |            |
| 役員賞与引当金       | —             |                            |            |
| 株式給付引当金       | 109           |                            |            |
| 退職給付に係る負債     | 12,168        |                            |            |
| ポイント引当金       | 17,497        |                            |            |
| 睡眠預金払戻損失引当金   | 4,275         |                            |            |
| 偶発損失引当金       | 1,385         |                            |            |
| 繰延税金負債        | 137,552       |                            | 4-b        |
| 再評価に係る繰延税金負債  | 2,455         |                            | 4-c        |
| 支払承諾          | 584,926       |                            |            |
| 負債の部合計        | 54,535,609    |                            |            |
| (純資産の部)       |               |                            |            |
| 資本金           | 342,037       |                            | 1-a        |
| 資本剰余金         | 342,853       |                            | 1-b        |
| 利益剰余金         | 1,270,838     |                            | 1-c        |
| 株主資本合計        | 1,955,728     |                            |            |
| その他有価証券評価差額金  | 455,538       |                            |            |
| 繰延ヘッジ損益       | △ 49,198      |                            | 5          |
| 土地再評価差額金      | △ 3,409       |                            |            |
| 為替換算調整勘定      | △ 2,393       |                            |            |
| 退職給付に係る調整累計額  | △ 20,659      |                            |            |
| その他の包括利益累計額合計 | 379,878       | (a)                        |            |
| 非支配株主持分       | 27,294        |                            | 7          |
| 純資産の部合計       | 2,362,901     |                            |            |
| 負債及び純資産の部合計   | 56,898,511    |                            |            |

(注) 1. 規制上の連結の範囲と会計上の連結の範囲は同一であります。

## (付表)

(注) 本表の「自己資本の構成に関する開示項目」の金額については、経過措置により自己資本に算入されている項目については含んでおりません。

## 1. 株主資本

## (1) 連結貸借対照表

(単位：百万円)

| 連結貸借対照表科目 | 金額        | 備考 | 参照番号 |
|-----------|-----------|----|------|
| 資本金       | 342,037   |    | 1-a  |
| 資本剰余金     | 342,853   |    | 1-b  |
| 利益剰余金     | 1,270,838 |    | 1-c  |
| 株主資本合計    | 1,955,728 |    |      |

## (2) 自己資本の構成

(単位：百万円)

| 自己資本の構成に関する開示項目    | 金額        | 備考                            | 国際様式の<br>該当番号 |
|--------------------|-----------|-------------------------------|---------------|
| 普通株式等Tier1資本に係る額   | 1,955,728 | 普通株式に係る株主資本（社外流出<br>予定額調整前）   |               |
| うち、資本金及び資本剰余金の額    | 684,890   |                               | 1a            |
| うち、利益剰余金の額         | 1,270,838 |                               | 2             |
| うち、自己株式の額（△）       | —         |                               | 1c            |
| うち、上記以外に該当するものの額   | —         |                               |               |
| その他Tier1資本調達手段に係る額 | —         | 実質破綻時損失吸収条項のある優<br>先株式に係る株主資本 | 31a           |

## 2. 無形固定資産

## (1) 連結貸借対照表

(単位：百万円)

| 連結貸借対照表科目           | 金額        | 備考 | 参照番号 |
|---------------------|-----------|----|------|
| 無形固定資産              | 120,607   |    | 2-a  |
| 有価証券                | 6,060,402 |    | 2-b  |
| うち、持分法適用会社に係るのれん相当額 | 4,618     |    |      |
| 上記に係る税効果            | 26,899    |    |      |

## (2) 自己資本の構成

(単位：百万円)

| 自己資本の構成に関する開示項目                                | 金額     | 備考                                    | 国際様式の<br>該当番号 |
|------------------------------------------------|--------|---------------------------------------|---------------|
| 無形固定資産 のれんに係るもの                                | 34,836 |                                       | 8             |
| 無形固定資産 その他の無形固定資産                              | 63,490 | のれん、モーゲージ・サービシン<br>グ・ライセンス以外（ソフトウェア等） | 9             |
| 無形固定資産 モーゲージ・サービシング・ライセンス                      | —      |                                       |               |
| 特定項目に係る十パーセント基準超過額                             | —      |                                       | 20            |
| 特定項目に係る十五パーセント基準超過額                            | —      |                                       | 24            |
| 無形固定資産（モーゲージ・サービシング・ライセンスに係るものに限り。）に係る調整項目不算入額 | —      |                                       | 74            |

## 3. 退職給付に係る資産

## (1) 連結貸借対照表

(単位：百万円)

| 連結貸借対照表科目 | 金額      | 備考 | 参照番号 |
|-----------|---------|----|------|
| 退職給付に係る資産 | 150,219 |    | 3    |
| 上記に係る税効果  | 46,009  |    |      |

## (2) 自己資本の構成

(単位：百万円)

| 自己資本の構成に関する開示項目 | 金額      | 備考 | 国際様式の<br>該当番号 |
|-----------------|---------|----|---------------|
| 退職給付に係る資産の額     | 104,210 |    | 15            |

## 4. 繰延税金資産

## (1) 連結貸借対照表

(単位：百万円)

| 連結貸借対照表科目    | 金額      | 備考 | 参照番号 |
|--------------|---------|----|------|
| 繰延税金資産       | 28,654  |    | 4-a  |
| 繰延税金負債       | 137,552 |    | 4-b  |
| 再評価に係る繰延税金負債 | 2,455   |    | 4-c  |

その他の無形固定資産の税効果勘案分

26,899

退職給付に係る資産の額の税効果勘案分

46,009

## (2) 自己資本の構成

(単位：百万円)

| 自己資本の構成に関する開示項目                  | 金額  | 備考                           | 国際様式の<br>該当番号 |
|----------------------------------|-----|------------------------------|---------------|
| 繰延税金資産（一時差異に係るものを除く。）            | 443 | 資産負債相殺処理のため、連結貸借対照表計上額とは一致せず | 10            |
| 一時差異に係る繰延税金資産                    | —   | 資産負債相殺処理のため、連結貸借対照表計上額とは一致せず |               |
| 特定項目に係る十パーセント基準超過額               | —   |                              | 21            |
| 特定項目に係る十五パーセント基準超過額              | —   |                              | 25            |
| 繰延税金資産（一時差異に係るものに限る。）に係る調整項目不算入額 | —   |                              | 75            |

## 5. 繰延ヘッジ損益

## (1) 連結貸借対照表

(単位：百万円)

| 連結貸借対照表科目 | 金額       | 備考 | 参照番号 |
|-----------|----------|----|------|
| 繰延ヘッジ損益   | △ 49,198 |    | 5    |

## (2) 自己資本の構成

(単位：百万円)

| 自己資本の構成に関する開示項目 | 金額       | 備考                                             | 国際様式の<br>該当番号 |
|-----------------|----------|------------------------------------------------|---------------|
| 繰延ヘッジ損益の額       | △ 41,746 | ヘッジ対象に係る時価評価差額が「その他の包括利益累計額」として計上されているものを除いたもの | 11            |

## 6. 金融機関向け出資等

## (1) 連結貸借対照表

(単位：百万円)

| 連結貸借対照表科目 | 金額         | 備考         | 参照番号 |
|-----------|------------|------------|------|
| 有価証券      | 6,060,402  |            | 6-a  |
| 貸出金       | 29,083,657 | 劣後債務等を含む   | 6-b  |
| その他資産     | 1,709,683  | 金融派生商品等を含む | 6-c  |
| その他負債     | 905,893    | 金融派生商品等を含む | 6-d  |

## (2) 自己資本の構成

(単位：百万円)

| 自己資本の構成に関する開示項目                            | 金額      | 備考 | 国際様式の<br>該当番号 |
|--------------------------------------------|---------|----|---------------|
| 自己保有資本調達手段の額                               | —       |    |               |
| 普通株式等Tier1相当額                              | —       |    | 16            |
| その他Tier1相当額                                | —       |    | 37            |
| Tier2相当額                                   | —       |    | 52            |
| 意図的に保有している他の金融機関等の資本等調達手段の額                | —       |    |               |
| 普通株式等Tier1相当額                              | —       |    | 17            |
| その他Tier1相当額                                | —       |    | 38            |
| Tier2相当額およびその他外部TLAC関連相当額                  | —       |    | 53            |
| 少数出資金融機関等の資本等調達手段の額                        | 121,383 |    |               |
| 普通株式等Tier1相当額                              | —       |    | 18            |
| その他Tier1相当額                                | —       |    | 39            |
| Tier2相当額およびその他外部TLAC関連相当額                  | —       |    | 54            |
| 少数出資金融機関等の対象資本等調達手段に係る調整<br>項目不算入額         | 121,383 |    | 72            |
| その他金融機関等（10%超出資）に係る資本等調達手段の額               | 99,543  |    |               |
| 特定項目に係る十パーセント基準超過額                         | —       |    | 19            |
| 特定項目に係る十五パーセント基準超過額                        | —       |    | 23            |
| その他Tier1相当額                                | —       |    | 40            |
| Tier2相当額およびその他外部TLAC関連相当額                  | 1,540   |    | 55            |
| その他金融機関等に係る対象資本等調達手段のうち普通<br>株式に係る調整項目不算入額 | 98,003  |    | 73            |

## 7. 非支配株主持分

## (1) 連結貸借対照表

(単位：百万円)

| 連結貸借対照表科目 | 金額     | 備考 | 参照番号 |
|-----------|--------|----|------|
| 非支配株主持分   | 27,294 |    | 7    |

## (2) 自己資本の構成

(単位：百万円)

| 自己資本の構成に関する開示項目              | 金額     | 備考                       | 国際様式の<br>該当番号 |
|------------------------------|--------|--------------------------|---------------|
| 普通株式等Tier1資本に係る額             | —      | 算入可能額（調整後非支配株主持分）<br>勘案後 | 5             |
| 特別目的会社等の発行するその他Tier1資本調達手段の額 | —      |                          | 30-31ab-32    |
| その他Tier1資本に係る額               | 11,391 | 算入可能額（調整後非支配株主持分）<br>勘案後 | 34-35         |
| 特別目的会社等の発行するTier2資本調達手段の額    | —      |                          | 46            |
| Tier2資本に係る額                  | 2,343  | 算入可能額（調整後非支配株主持分）<br>勘案後 | 48-49         |

## 8. その他資本調達

## (1) 連結貸借対照表

(単位：百万円)

| 連結貸借対照表科目 | 金額        | 備考 | 参照番号 |
|-----------|-----------|----|------|
| 借入金       | 4,710,891 |    | 8    |

## (2) 自己資本の構成

(単位：百万円)

| 自己資本の構成に関する開示項目       | 金額      | 備考 | 国際様式の<br>該当番号 |
|-----------------------|---------|----|---------------|
| その他Tier1資本調達手段に係る負債の額 | 340,000 |    | 32            |
| Tier2資本調達手段に係る負債の額    | 309,589 |    | 46            |

## リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算に関する事項

## リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算が適用されるエクスポージャーの額

(単位：百万円)

|                             | 2020年9月末  | 2019年9月末  |
|-----------------------------|-----------|-----------|
| みなし計算が適用されるエクスポージャーの額合計     | 1,371,472 | 1,600,700 |
| ルック・スルー方式                   | 1,167,096 | 1,419,204 |
| マンドート方式                     | 204,288   | 181,396   |
| 蓋然性方式（リスク・ウェイト250%適用）       | —         | —         |
| 蓋然性方式（リスク・ウェイト400%適用）       | —         | —         |
| フォールバック方式（リスク・ウェイト1,250%適用） | 88        | 99        |

(注) 1. 信用リスク・アセット算出対象となったエクスポージャーを表示しております。

三井住友トラスト・ホールディングス  
決算データ三井住友信託銀行  
決算データ三井住友トラスト・ホールディングス  
バーゼルIII関連データ三井住友信託銀行  
バーゼルIII関連データ

開示項目一覧

## 別紙様式による開示事項

## OV1：リスク・アセットの概要

(単位：百万円)

| 国際様式の<br>該当番号 |                                                                 | OV1                  |            |                    |           |
|---------------|-----------------------------------------------------------------|----------------------|------------|--------------------|-----------|
|               |                                                                 | イ                    | ロ          | ハ                  | ニ         |
|               |                                                                 | リスク・アセット<br>2020年9月末 | 2019年9月末   | 所要自己資本<br>2020年9月末 | 2019年9月末  |
| 1             | 信用リスク                                                           | 12,116,740           | 12,152,104 | 1,023,301          | 1,026,822 |
| 2             | うち、標準的手法適用分                                                     | 348,974              | 297,989    | 27,917             | 23,839    |
| 3             | うち、内部格付手法適用分                                                    | 11,242,063           | 11,386,340 | 953,327            | 965,561   |
|               | うち、重要な出資のエクスポージャー                                               | —                    | —          | —                  | —         |
|               | うち、リース取引における見積残存価額のエクスポージャー                                     | 62,402               | 30,359     | 4,992              | 2,428     |
|               | その他                                                             | 463,299              | 437,414    | 37,063             | 34,993    |
| 4             | カウンターパーティ信用リスク                                                  | 1,213,814            | 1,114,942  | 99,088             | 90,887    |
| 5             | うち、SA-CCR適用分                                                    | —                    | —          | —                  | —         |
|               | うち、カレント・エクスポージャー方式適用分                                           | 389,420              | 334,952    | 33,012             | 28,389    |
| 6             | うち、期待エクスポージャー方式適用分                                              | —                    | —          | —                  | —         |
|               | うち、CVAリスク                                                       | 666,708              | 643,868    | 53,336             | 51,509    |
|               | うち、中央清算機関関連エクスポージャー                                             | 52,555               | 47,669     | 4,204              | 3,813     |
|               | その他                                                             | 105,129              | 88,452     | 8,534              | 7,175     |
| 7             | マーケット・ベース方式に基づく株式等エクスポージャー                                      | 249,395              | 240,052    | 21,148             | 20,356    |
| 8             | リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算<br>(ルック・スルー方式)                 | 1,347,216            | 1,235,895  | 107,777            | 98,871    |
| 9             | リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算<br>(マンドート方式)                   | 842,419              | 753,025    | 67,393             | 60,242    |
|               | リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算<br>(蓋然性方式250%)                 | —                    | —          | —                  | —         |
|               | リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算<br>(蓋然性方式400%)                 | —                    | —          | —                  | —         |
| 10            | リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算<br>(フォールバック方式1,250%)           | 1,103                | 1,238      | 88                 | 99        |
| 11            | 未決済取引                                                           | —                    | —          | —                  | —         |
| 12            | 信用リスク・アセットの額の算出対象となっている証券化エクスポージャー                              | 313,985              | 345,127    | 25,118             | 27,610    |
| 13            | うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分                                        | 295,189              | 331,655    | 23,615             | 26,532    |
| 14            | うち、外部格付準拠方式適用分                                                  | 18,056               | 12,391     | 1,444              | 991       |
| 15            | うち、標準的手法準拠方式適用分                                                 | —                    | —          | —                  | —         |
|               | うち、1,250%のリスク・ウェイト適用分                                           | 739                  | 1,080      | 59                 | 86        |
| 16            | マーケット・リスク                                                       | 1,321,748            | 981,661    | 105,739            | 78,532    |
| 17            | うち、標準的方式適用分                                                     | 12,277               | 11,776     | 982                | 942       |
| 18            | うち、内部モデル方式適用分                                                   | 1,309,470            | 969,885    | 104,757            | 77,590    |
| 19            | オペレーショナル・リスク                                                    | 878,468              | 864,666    | 70,277             | 69,173    |
| 20            | うち、基礎的手法適用分                                                     | 157,690              | 169,798    | 12,615             | 13,583    |
| 21            | うち、粗利益配分手法適用分                                                   | —                    | —          | —                  | —         |
| 22            | うち、先進的計測手法適用分                                                   | 720,778              | 694,868    | 57,662             | 55,589    |
| 23            | 特定項目のうち、調整項目に算入されない部分に係るエクスポージャー<br>経過措置によりリスク・アセットの額に算入されるものの額 | 265,933              | 245,007    | 22,551             | 20,776    |
| 24            | フロア調整                                                           | —                    | —          | —                  | —         |
| 25            | 合計（スケーリングファクター適用後）                                              | 19,281,057           | 18,667,159 | 1,542,484          | 1,493,372 |

(注) 1. 項番25のリスク・アセットのみスケーリングファクターを適用した値を記載しております。

## CR1：資産の信用の質

(単位：百万円)

| CR1           |                            | 2020年9月末            |                    |         |                  |
|---------------|----------------------------|---------------------|--------------------|---------|------------------|
| 項番            |                            | イ                   | ロ                  | ハ       | ニ                |
|               |                            | 帳簿価額の総額             |                    | 引当金     | ネット金額<br>(イ+ロ-ハ) |
|               |                            | デフォルトした<br>エクスポージャー | 非デフォルト<br>エクスポージャー |         |                  |
| オン・バランスシートの資産 |                            |                     |                    |         |                  |
| 1             | 貸出金                        | 141,278             | 29,560,678         | 109,222 | 29,592,734       |
| 2             | 有価証券（うち負債性のもの）             | 761                 | 3,377,145          | —       | 3,377,907        |
| 3             | その他オン・バランスシートの資産（うち負債性のもの） | 20,430              | 18,274,264         | 14,740  | 18,279,954       |
| 4             | オン・バランスシートの資産の合計（1+2+3）    | 162,470             | 51,212,089         | 123,963 | 51,250,596       |
| オフ・バランスシートの資産 |                            |                     |                    |         |                  |
| 5             | 支払承諾等                      | 150                 | 520,618            | 933     | 519,835          |
| 6             | コミットメント等                   | 40                  | 4,376,528          | 1,455   | 4,375,113        |
| 7             | オフ・バランスシートの資産の合計（5+6）      | 191                 | 4,897,147          | 2,389   | 4,894,949        |
| 合計            |                            |                     |                    |         |                  |
| 8             | 合計（4+7）                    | 162,661             | 56,109,236         | 126,352 | 56,145,545       |

(注) 1. 本面の集計上、カウンターパーティ信用リスク、証券化取引に係る信用リスク、リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算に係る信用リスクは含まれておりません。

(単位：百万円)

| CR1           |                            | 2019年9月末            |                    |        |                  |
|---------------|----------------------------|---------------------|--------------------|--------|------------------|
| 項番            |                            | イ                   | ロ                  | ハ      | ニ                |
|               |                            | 帳簿価額の総額             |                    | 引当金    | ネット金額<br>(イ+ロ-ハ) |
|               |                            | デフォルトした<br>エクスポージャー | 非デフォルト<br>エクスポージャー |        |                  |
| オン・バランスシートの資産 |                            |                     |                    |        |                  |
| 1             | 貸出金                        | 134,746             | 28,439,258         | 77,994 | 28,496,010       |
| 2             | 有価証券（うち負債性のもの）             | 0                   | 2,485,142          | －      | 2,485,142        |
| 3             | その他オン・バランスシートの資産（うち負債性のもの） | 20,795              | 17,712,789         | 10,001 | 17,723,583       |
| 4             | オン・バランスシートの資産の合計（1+2+3）    | 155,541             | 48,637,190         | 87,995 | 48,704,737       |
| オフ・バランスシートの資産 |                            |                     |                    |        |                  |
| 5             | 支払承諾等                      | 694                 | 584,113            | 1,273  | 583,534          |
| 6             | コミットメント等                   | 1,118               | 3,909,797          | 1,385  | 3,909,530        |
| 7             | オフ・バランスシートの資産の合計（5+6）      | 1,813               | 4,493,910          | 2,658  | 4,493,064        |
| 合計            |                            |                     |                    |        |                  |
| 8             | 合計（4+7）                    | 157,355             | 53,131,101         | 90,654 | 53,197,802       |

(注) 1. 本面の集計上、カウンターパーティ信用リスク、証券化取引に係る信用リスク、リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算に係る信用リスクは含まれておりません。

三井住友トラスト・ホールディングス  
決算データ三井住友信託銀行  
決算データ

三井住友トラスト・ホールディングス・パーゼル川関連データ

三井住友信託銀行  
パーゼル川関連データ

開示項目一覧

## CR2：デフォルトした貸出金・有価証券等（うち負債性のもの）の残高の変動

(単位：百万円)

| CR2 |                                                        |                | 2020年9月末 |
|-----|--------------------------------------------------------|----------------|----------|
| 項番  |                                                        |                | 額        |
| 1   | 前事業年度末時点においてデフォルト状態にある貸出金・有価証券等（うち負債性のもの）の残高           |                | 143,609  |
| 2   | 貸出金・有価証券等（うち負債性のもの）の当中間期中の要因別の変動額                      | デフォルトした額       | 41,751   |
| 3   |                                                        | 非デフォルト状態へ復帰した額 | 8,084    |
| 4   |                                                        | 償却された額         | 3,003    |
| 5   |                                                        | その他の変動額        | △ 11,802 |
| 6   | 当中間期末時点においてデフォルト状態にある貸出金・有価証券等（うち負債性のもの）の残高（1+2-3-4+5） |                | 162,470  |

(注) 1. 前事業年度末：2020年3月末、当中間期末：2020年9月末

2. 項番5「その他の変動額」の主な要因は、デフォルト状態にあるエクスポージャーの回収による残高減少であります。

(単位：百万円)

| CR2 |                                                        |                | 2019年9月末 |
|-----|--------------------------------------------------------|----------------|----------|
| 項番  |                                                        |                | 額        |
| 1   | 前事業年度末時点においてデフォルト状態にある貸出金・有価証券等（うち負債性のもの）の残高           |                | 138,273  |
| 2   | 貸出金・有価証券等（うち負債性のもの）の当中間期中の要因別の変動額                      | デフォルトした額       | 59,177   |
| 3   |                                                        | 非デフォルト状態へ復帰した額 | 17,005   |
| 4   |                                                        | 償却された額         | 9,793    |
| 5   |                                                        | その他の変動額        | △ 15,111 |
| 6   | 当中間期末時点においてデフォルト状態にある貸出金・有価証券等（うち負債性のもの）の残高（1+2-3-4+5） |                | 155,541  |

(注) 1. 前事業年度末：2019年3月末、当中間期末：2019年9月末

2. 項番5「その他の変動額」の主な要因は、デフォルト状態にあるエクスポージャーの回収による残高減少であります。

## CR3：信用リスク削減手法

(単位：百万円)

| CR3 |                              | 2020年9月末        |                   |                      |                      |                                        |
|-----|------------------------------|-----------------|-------------------|----------------------|----------------------|----------------------------------------|
| 項番  |                              | イ               | ロ                 | ハ                    | ニ                    | ホ                                      |
|     |                              | 非保全<br>エクスポージャー | 保全された<br>エクスポージャー | 担保で保全された<br>エクスポージャー | 保証で保全された<br>エクスポージャー | クレジット・<br>デリバティブで<br>保全された<br>エクスポージャー |
| 1   | 貸出金                          | 28,984,336      | 608,398           | 290,459              | 188,504              | —                                      |
| 2   | 有価証券（負債性のもの）                 | 3,326,270       | 51,636            | 1,000                | 50,104               | —                                      |
| 3   | その他オン・バランスシートの資産<br>（負債性のもの） | 18,279,818      | 136               | 131                  | 4                    | —                                      |
| 4   | 合計（1+2+3）                    | 50,590,425      | 660,171           | 291,591              | 238,613              | —                                      |
| 5   | うちデフォルトしたもの                  | 127,214         | 6,234             | 4,783                | —                    | —                                      |

(単位：百万円)

| CR3 |                              | 2019年9月末        |                   |                      |                      |                                        |
|-----|------------------------------|-----------------|-------------------|----------------------|----------------------|----------------------------------------|
| 項番  |                              | イ               | ロ                 | ハ                    | ニ                    | ホ                                      |
|     |                              | 非保全<br>エクスポージャー | 保全された<br>エクスポージャー | 担保で保全された<br>エクスポージャー | 保証で保全された<br>エクスポージャー | クレジット・<br>デリバティブで<br>保全された<br>エクスポージャー |
| 1   | 貸出金                          | 27,945,324      | 550,686           | 271,575              | 170,674              | —                                      |
| 2   | 有価証券（負債性のもの）                 | 2,408,329       | 76,813            | 2,800                | 72,775               | —                                      |
| 3   | その他オン・バランスシートの資産<br>（負債性のもの） | 17,718,456      | 5,127             | 123                  | 5,004                | —                                      |
| 4   | 合計（1+2+3）                    | 48,072,110      | 632,626           | 274,498              | 248,454              | —                                      |
| 5   | うちデフォルトしたもの                  | 129,780         | 5,549             | 4,607                | —                    | —                                      |

三井住友トラスト・  
ホールディングス  
決算データ三井住友信託銀行  
決算データ三井住友トラスト・  
ホールディングス  
パーゼル川関連データ三井住友信託銀行  
パーゼル川関連データ

開示項目一覧

## CR4：標準的手法－信用リスク・エクスポージャーと信用リスク削減手法の効果

(単位：百万円、%)

| CR4 |                        | 2020年9月末                  |              |                           |              |              |                              |
|-----|------------------------|---------------------------|--------------|---------------------------|--------------|--------------|------------------------------|
| 項番  |                        | イ                         | ロ            | ハ                         | ニ            | ホ            | ヘ                            |
|     |                        | CCF・信用リスク削減手法適用前のエクスポージャー |              | CCF・信用リスク削減手法適用後のエクスポージャー |              | 信用リスク・アセットの額 | リスク・ウェイトの加重平均値 (RWA density) |
|     | 資産クラス                  | オン・バランスシートの額              | オフ・バランスシートの額 | オン・バランスシートの額              | オフ・バランスシートの額 |              |                              |
| 1   | 現金                     | 14                        | —            | 14                        | —            | —            | —                            |
| 2   | 日本国政府及び日本銀行向け          | 60                        | —            | 60                        | —            | —            | —                            |
| 3   | 外国の中央政府及び中央銀行向け        | 365,211                   | —            | 365,211                   | —            | 17,582       | 4.81                         |
| 4   | 国際決済銀行等向け              | —                         | —            | —                         | —            | —            | —                            |
| 5   | 我が国の地方公共団体向け           | —                         | —            | —                         | —            | —            | —                            |
| 6   | 外国の中央政府等以外の公共部門向け      | —                         | —            | —                         | —            | —            | —                            |
| 7   | 国際開発銀行向け               | —                         | —            | —                         | —            | —            | —                            |
| 8   | 地方公共団体金融機構向け           | —                         | —            | —                         | —            | —            | —                            |
| 9   | 我が国の政府関係機関向け           | —                         | —            | —                         | —            | —            | —                            |
| 10  | 地方三公社向け                | —                         | —            | —                         | —            | —            | —                            |
| 11  | 金融機関及び第一種金融商品取引業者向け    | 216,768                   | 138          | 216,768                   | 138          | 130,020      | 59.94                        |
| 12  | 法人等向け                  | 185,788                   | 331,437      | 185,788                   | 15,656       | 201,370      | 99.96                        |
| 13  | 中小企業等向け及び個人向け          | —                         | —            | —                         | —            | —            | —                            |
| 14  | 抵当権付住宅ローン              | —                         | —            | —                         | —            | —            | —                            |
| 15  | 不動産取得等事業向け             | —                         | —            | —                         | —            | —            | —                            |
| 16  | 三月以上延滞等（抵当権付住宅ローンを除く。） | —                         | —            | —                         | —            | —            | 110.71                       |
| 17  | 抵当権付住宅ローンに係る三月以上延滞     | —                         | —            | —                         | —            | —            | —                            |
| 18  | 取立未済手形                 | —                         | —            | —                         | —            | —            | —                            |
| 19  | 信用保証協会等による保証付          | —                         | —            | —                         | —            | —            | —                            |
| 20  | 株式会社地域経済活性化支援機構等による保証付 | —                         | —            | —                         | —            | —            | —                            |
| 21  | 出資等（重要な出資を除く。）         | —                         | —            | —                         | —            | —            | —                            |
| 22  | 合計                     | 767,842                   | 331,576      | 767,842                   | 15,794       | 348,974      | 44.53                        |

三井住友トラスト・ホールディングス  
決算データ

三井住友信託銀行  
決算データ

三井住友トラスト・ホールディングス  
パーゼル川関連データ

三井住友信託銀行  
パーゼル川関連データ

開示項目一覧

(単位：百万円、%)

| CR4 |                        | 2019年9月末                  |              |                           |              |              |                              |
|-----|------------------------|---------------------------|--------------|---------------------------|--------------|--------------|------------------------------|
| 項番  |                        | イ                         | ロ            | ハ                         | ニ            | ホ            | ヘ                            |
|     |                        | CCF・信用リスク削減手法適用前のエクスポージャー |              | CCF・信用リスク削減手法適用後のエクスポージャー |              | 信用リスク・アセットの額 | リスク・ウェイトの加重平均値 (RWA density) |
|     | 資産クラス                  | オン・バランスシートの額              | オフ・バランスシートの額 | オン・バランスシートの額              | オフ・バランスシートの額 |              |                              |
| 1   | 現金                     | 42                        | —            | 42                        | —            | —            | —                            |
| 2   | 日本国政府及び日本銀行向け          | 60                        | —            | 60                        | —            | —            | —                            |
| 3   | 外国の中央政府及び中央銀行向け        | 348,632                   | —            | 348,632                   | —            | 28,615       | 8.20                         |
| 4   | 国際決済銀行等向け              | —                         | —            | —                         | —            | —            | —                            |
| 5   | 我が国の地方公共団体向け           | —                         | —            | —                         | —            | —            | —                            |
| 6   | 外国の中央政府等以外の公共部門向け      | —                         | —            | —                         | —            | —            | —                            |
| 7   | 国際開発銀行向け               | —                         | —            | —                         | —            | —            | —                            |
| 8   | 地方公共団体金融機構向け           | —                         | —            | —                         | —            | —            | —                            |
| 9   | 我が国の政府関係機関向け           | —                         | —            | —                         | —            | —            | —                            |
| 10  | 地方三公社向け                | —                         | —            | —                         | —            | —            | —                            |
| 11  | 金融機関及び第一種金融商品取引業者向け    | 108,438                   | —            | 108,438                   | —            | 35,667       | 32.89                        |
| 12  | 法人等向け                  | 225,181                   | 378,150      | 225,181                   | 9,414        | 233,705      | 99.62                        |
| 13  | 中小企業等向け及び個人向け          | —                         | —            | —                         | —            | —            | —                            |
| 14  | 抵当権付住宅ローン              | —                         | —            | —                         | —            | —            | —                            |
| 15  | 不動産取得等事業向け             | —                         | —            | —                         | —            | —            | —                            |
| 16  | 三月以上延滞等（抵当権付住宅ローンを除く。） | 1                         | —            | 1                         | —            | 1            | 100.53                       |
| 17  | 抵当権付住宅ローンに係る三月以上延滞     | —                         | —            | —                         | —            | —            | —                            |
| 18  | 取立未済手形                 | —                         | —            | —                         | —            | —            | —                            |
| 19  | 信用保証協会等による保証付          | —                         | —            | —                         | —            | —            | —                            |
| 20  | 株式会社地域経済活性化支援機構等による保証付 | —                         | —            | —                         | —            | —            | —                            |
| 21  | 出資等（重要な出資を除く。）         | —                         | —            | —                         | —            | —            | —                            |
| 22  | 合計                     | 682,356                   | 378,150      | 682,356                   | 9,414        | 297,989      | 43.07                        |

三井住友トラスト・ホールディングス  
決算データ三井住友信託銀行  
決算データ三井住友トラスト・ホールディングス  
パーゼル川関連データ三井住友信託銀行  
パーゼル川関連データ

開示項目一覧

## CR5：標準的手法－資産クラス及びリスク・ウェイト別の信用リスク・エクスポージャー

(単位：百万円)

| CR5 |                        | 2020年9月末                           |    |         |     |        |     |         |      |      |      |         |    |
|-----|------------------------|------------------------------------|----|---------|-----|--------|-----|---------|------|------|------|---------|----|
| 項番  |                        | イ                                  | ロ  | ハ       | ニ   | ホ      | ヘ   | ト       | チ    | リ    | ヌ    | ル       |    |
|     |                        | 信用リスク・エクスポージャーの額（CCF・信用リスク削減手法適用後） |    |         |     |        |     |         |      |      |      |         |    |
|     | リスク・ウェイト               | 資産クラス                              | 0% | 10%     | 20% | 35%    | 50% | 75%     | 100% | 150% | 250% | 1,250%  | 合計 |
| 1   | 現金                     | 14                                 | －  | －       | －   | －      | －   | －       | －    | －    | －    | 14      |    |
| 2   | 日本国政府及び日本銀行向け          | 60                                 | －  | －       | －   | －      | －   | －       | －    | －    | －    | 60      |    |
| 3   | 外国の中央政府及び中央銀行向け        | 330,047                            | －  | －       | －   | 35,162 | －   | 1       | －    | －    | －    | 365,211 |    |
| 4   | 国際決済銀行等向け              | －                                  | －  | －       | －   | －      | －   | －       | －    | －    | －    | －       |    |
| 5   | 我が国の地方公共団体向け           | －                                  | －  | －       | －   | －      | －   | －       | －    | －    | －    | －       |    |
| 6   | 外国の中央政府等以外の公共部門向け      | －                                  | －  | －       | －   | －      | －   | －       | －    | －    | －    | －       |    |
| 7   | 国際開発銀行向け               | －                                  | －  | －       | －   | －      | －   | －       | －    | －    | －    | －       |    |
| 8   | 地方公共団体金融機構向け           | －                                  | －  | －       | －   | －      | －   | －       | －    | －    | －    | －       |    |
| 9   | 我が国の政府関係機関向け           | －                                  | －  | －       | －   | －      | －   | －       | －    | －    | －    | －       |    |
| 10  | 地方三公社向け                | －                                  | －  | －       | －   | －      | －   | －       | －    | －    | －    | －       |    |
| 11  | 金融機関及び第一種金融商品取引業者向け    | －                                  | －  | 108,362 | －   | 393    | －   | 108,151 | －    | －    | －    | 216,907 |    |
| 12  | 法人等向け                  | －                                  | －  | －       | －   | 146    | －   | 201,297 | －    | －    | －    | 201,444 |    |
| 13  | 中小企業等向け及び個人向け          | －                                  | －  | －       | －   | －      | －   | －       | －    | －    | －    | －       |    |
| 14  | 抵当権付住宅ローン              | －                                  | －  | －       | －   | －      | －   | －       | －    | －    | －    | －       |    |
| 15  | 不動産取得等事業向け             | －                                  | －  | －       | －   | －      | －   | －       | －    | －    | －    | －       |    |
| 16  | 三月以上延滞等（抵当権付住宅ローンを除く。） | －                                  | －  | －       | －   | 0      | －   | 0       | 0    | －    | －    | 0       |    |
| 17  | 抵当権付住宅ローンに係る三月以上延滞     | －                                  | －  | －       | －   | －      | －   | －       | －    | －    | －    | －       |    |
| 18  | 取立未済手形                 | －                                  | －  | －       | －   | －      | －   | －       | －    | －    | －    | －       |    |
| 19  | 信用保証協会等による保証付          | －                                  | －  | －       | －   | －      | －   | －       | －    | －    | －    | －       |    |
| 20  | 株式会社地域経済活性化支援機構等による保証付 | －                                  | －  | －       | －   | －      | －   | －       | －    | －    | －    | －       |    |
| 21  | 出資等（重要な出資を除く。）         | －                                  | －  | －       | －   | －      | －   | －       | －    | －    | －    | －       |    |
| 22  | 合計                     | 330,121                            | －  | 108,362 | －   | 35,702 | －   | 309,450 | 0    | －    | －    | 783,637 |    |

三井住友トラスト・ホールディングス  
決算データ三井住友信託銀行  
決算データ三井住友トラスト・ホールディングス  
パーゼル川関連データ三井住友信託銀行  
パーゼル川関連データ

開示項目一覧

(単位：百万円)

| CR5 |                        | 2019年9月末                           |     |        |     |        |     |         |      |      |        |         |  |
|-----|------------------------|------------------------------------|-----|--------|-----|--------|-----|---------|------|------|--------|---------|--|
| 項番  | 資産クラス<br>リスク・ウェイト      | イ                                  | ロ   | ハ      | ニ   | ホ      | ヘ   | ト       | チ    | リ    | ヌ      | ル       |  |
|     |                        | 信用リスク・エクスポージャーの額（CCF・信用リスク削減手法適用後） |     |        |     |        |     |         |      |      |        |         |  |
|     |                        | 0%                                 | 10% | 20%    | 35% | 50%    | 75% | 100%    | 150% | 250% | 1,250% | 合計      |  |
| 1   | 現金                     | 42                                 | —   | —      | —   | —      | —   | —       | —    | —    | —      | 42      |  |
| 2   | 日本国政府及び日本銀行向け          | 60                                 | —   | —      | —   | —      | —   | —       | —    | —    | —      | 60      |  |
| 3   | 外国の中央政府及び中央銀行向け        | 291,401                            | —   | —      | —   | 57,231 | —   | —       | —    | —    | —      | 348,632 |  |
| 4   | 国際決済銀行等向け              | —                                  | —   | —      | —   | —      | —   | —       | —    | —    | —      | —       |  |
| 5   | 我が国の地方公共団体向け           | —                                  | —   | —      | —   | —      | —   | —       | —    | —    | —      | —       |  |
| 6   | 外国の中央政府等以外の公共部門向け      | —                                  | —   | —      | —   | —      | —   | —       | —    | —    | —      | —       |  |
| 7   | 国際開発銀行向け               | —                                  | —   | —      | —   | —      | —   | —       | —    | —    | —      | —       |  |
| 8   | 地方公共団体金融機構向け           | —                                  | —   | —      | —   | —      | —   | —       | —    | —    | —      | —       |  |
| 9   | 我が国の政府関係機関向け           | —                                  | —   | —      | —   | —      | —   | —       | —    | —    | —      | —       |  |
| 10  | 地方三公社向け                | —                                  | —   | —      | —   | —      | —   | —       | —    | —    | —      | —       |  |
| 11  | 金融機関及び第一種金融商品取引業者向け    | —                                  | —   | 75,318 | —   | 25,032 | —   | 8,087   | —    | —    | —      | 108,438 |  |
| 12  | 法人等向け                  | —                                  | —   | —      | —   | 1,981  | —   | 232,613 | —    | —    | —      | 234,595 |  |
| 13  | 中小企業等向け及び個人向け          | —                                  | —   | —      | —   | —      | —   | —       | —    | —    | —      | —       |  |
| 14  | 抵当権付住宅ローン              | —                                  | —   | —      | —   | —      | —   | —       | —    | —    | —      | —       |  |
| 15  | 不動産取得等事業向け             | —                                  | —   | —      | —   | —      | —   | —       | —    | —    | —      | —       |  |
| 16  | 三月以上延滞等（抵当権付住宅ローンを除く。） | —                                  | —   | —      | —   | 0      | —   | —       | 0    | —    | —      | 1       |  |
| 17  | 抵当権付住宅ローンに係る三月以上延滞     | —                                  | —   | —      | —   | —      | —   | —       | —    | —    | —      | —       |  |
| 18  | 取立未済手形                 | —                                  | —   | —      | —   | —      | —   | —       | —    | —    | —      | —       |  |
| 19  | 信用保証協会等による保証付          | —                                  | —   | —      | —   | —      | —   | —       | —    | —    | —      | —       |  |
| 20  | 株式会社地域経済活性化支援機構等による保証付 | —                                  | —   | —      | —   | —      | —   | —       | —    | —    | —      | —       |  |
| 21  | 出資等（重要な出資を除く。）         | —                                  | —   | —      | —   | —      | —   | —       | —    | —    | —      | —       |  |
| 22  | 合計                     | 291,504                            | —   | 75,318 | —   | 84,245 | —   | 240,701 | 0    | —    | —      | 691,770 |  |

三井住友トラスト・ホールディングス  
決算データ三井住友信託銀行  
決算データ三井住友トラスト・ホールディングス  
パーゼル川関連データ三井住友信託銀行  
パーゼル川関連データ

開示項目一覧

## CR6：内部格付手法－ポートフォリオ及びデフォルト率（PD）区分別の信用リスク・エクスポージャー

(単位：百万円、%、千件、年)

| CR6                           |                 | 2020年9月末                 |                                        |        |                     |       |       |       |        |              |                             |     |       |
|-------------------------------|-----------------|--------------------------|----------------------------------------|--------|---------------------|-------|-------|-------|--------|--------------|-----------------------------|-----|-------|
| 項番                            | PD区分            | オン・バランスシート・グロスエクスポージャーの額 | CCF・信用リスク削減手法適用前のオフ・バランスシート・エクスポージャーの額 | 平均CCF  | CCF・信用リスク削減手法適用後EAD | 平均PD  | 債務者の数 | 平均LGD | 平均残存期間 | 信用リスク・アセットの額 | リスク・ウェイトの加重平均値(RWA density) | EL  | 適格引当金 |
| ソブリン向けエクスポージャー（先進的内部格付手法適用分）  |                 |                          |                                        |        |                     |       |       |       |        |              |                             |     |       |
| 1                             | 0.00以上0.15未満    | 2,534,973                | 33                                     | 75.00  | 2,551,338           | 0.00  | 0.0   | 32.09 | 1.8    | 15,212       | 0.59                        | 8   |       |
| 2                             | 0.15以上0.25未満    | 2,103                    | 469                                    | 75.00  | 52                  | 0.20  | 0.0   | 27.29 | 2.0    | 13           | 25.16                       | 0   |       |
| 3                             | 0.25以上0.50未満    | 897                      | —                                      | —      | —                   | —     | 0.0   | —     | —      | —            | —                           | —   |       |
| 4                             | 0.50以上0.75未満    | —                        | —                                      | —      | —                   | —     | —     | —     | —      | —            | —                           | —   |       |
| 5                             | 0.75以上2.50未満    | —                        | —                                      | —      | —                   | —     | —     | —     | —      | —            | —                           | —   |       |
| 6                             | 2.50以上10.00未満   | —                        | —                                      | —      | —                   | —     | —     | —     | —      | —            | —                           | —   |       |
| 7                             | 10.00以上100.00未満 | —                        | —                                      | —      | —                   | —     | —     | —     | —      | —            | —                           | —   |       |
| 8                             | 100.00（デフォルト）   | —                        | —                                      | —      | —                   | —     | —     | —     | —      | —            | —                           | —   |       |
| 9                             | 小計              | 2,537,974                | 502                                    | 75.00  | 2,551,390           | 0.00  | 0.0   | 32.09 | 1.8    | 15,226       | 0.59                        | 8   | 53    |
| ソブリン向けエクスポージャー（基礎的内部格付手法適用分）  |                 |                          |                                        |        |                     |       |       |       |        |              |                             |     |       |
| 1                             | 0.00以上0.15未満    | 17,464,151               | 67,220                                 | 77.33  | 17,566,371          | 0.00  | 0.0   | 44.99 | 1.0    | 54,685       | 0.31                        | 82  |       |
| 2                             | 0.15以上0.25未満    | 0                        | —                                      | —      | 0                   | 0.20  | 0.0   | 45.00 | 1.0    | 0            | 30.51                       | 0   |       |
| 3                             | 0.25以上0.50未満    | 48,841                   | 9,675                                  | 88.67  | 37,015              | 0.28  | 0.0   | 43.78 | 2.5    | 22,145       | 59.82                       | 45  |       |
| 4                             | 0.50以上0.75未満    | —                        | —                                      | —      | —                   | —     | —     | —     | —      | —            | —                           | —   |       |
| 5                             | 0.75以上2.50未満    | —                        | —                                      | —      | —                   | —     | —     | —     | —      | —            | —                           | —   |       |
| 6                             | 2.50以上10.00未満   | 17,354                   | —                                      | —      | 154                 | 8.98  | 0.0   | 45.00 | 1.3    | 264          | 171.59                      | 6   |       |
| 7                             | 10.00以上100.00未満 | 10,238                   | —                                      | —      | 238                 | 13.65 | 0.0   | 45.00 | 2.0    | 501          | 209.96                      | 14  |       |
| 8                             | 100.00（デフォルト）   | —                        | —                                      | —      | —                   | —     | —     | —     | —      | —            | —                           | —   |       |
| 9                             | 小計              | 17,540,585               | 76,895                                 | 78.76  | 17,603,780          | 0.00  | 0.1   | 44.99 | 1.0    | 77,597       | 0.44                        | 148 | 132   |
| 金融機関等向けエクスポージャー（先進的内部格付手法適用分） |                 |                          |                                        |        |                     |       |       |       |        |              |                             |     |       |
| 1                             | 0.00以上0.15未満    | 456,164                  | 12,000                                 | 100.00 | 487,304             | 0.05  | 0.0   | 32.10 | 3.7    | 123,083      | 25.25                       | 81  |       |
| 2                             | 0.15以上0.25未満    | 49,000                   | 9,000                                  | 75.00  | 55,750              | 0.20  | 0.0   | 32.10 | 1.1    | 12,600       | 22.60                       | 36  |       |
| 3                             | 0.25以上0.50未満    | —                        | —                                      | —      | —                   | —     | —     | —     | —      | —            | —                           | —   |       |
| 4                             | 0.50以上0.75未満    | 1,400                    | 1,000                                  | 75.00  | 2,150               | 0.50  | 0.0   | 32.10 | 1.0    | 804          | 37.40                       | 3   |       |
| 5                             | 0.75以上2.50未満    | 13,687                   | 9,412                                  | 88.74  | 22,040              | 1.14  | 0.0   | 32.10 | 1.0    | 12,112       | 54.95                       | 81  |       |
| 6                             | 2.50以上10.00未満   | —                        | —                                      | —      | —                   | —     | —     | —     | —      | —            | —                           | —   |       |
| 7                             | 10.00以上100.00未満 | —                        | —                                      | —      | —                   | —     | —     | —     | —      | —            | —                           | —   |       |
| 8                             | 100.00（デフォルト）   | —                        | —                                      | —      | —                   | —     | —     | —     | —      | —            | —                           | —   |       |
| 9                             | 小計              | 520,251                  | 31,412                                 | 88.66  | 567,244             | 0.11  | 0.0   | 32.10 | 3.3    | 148,600      | 26.19                       | 202 | 316   |
| 金融機関等向けエクスポージャー（基礎的内部格付手法適用分） |                 |                          |                                        |        |                     |       |       |       |        |              |                             |     |       |
| 1                             | 0.00以上0.15未満    | 191,773                  | 127,416                                | 79.68  | 293,292             | 0.06  | 0.0   | 43.34 | 2.0    | 72,568       | 24.74                       | 82  |       |
| 2                             | 0.15以上0.25未満    | 56                       | —                                      | —      | 56                  | 0.20  | 0.0   | 45.00 | 1.0    | 17           | 30.51                       | 0   |       |
| 3                             | 0.25以上0.50未満    | 12,003                   | —                                      | —      | 9,412               | 0.30  | 0.0   | 45.00 | 0.7    | 4,336        | 46.06                       | 12  |       |
| 4                             | 0.50以上0.75未満    | 0                        | —                                      | —      | 0                   | 0.50  | 0.0   | 45.00 | 1.0    | 0            | 52.44                       | 0   |       |
| 5                             | 0.75以上2.50未満    | 3,403                    | —                                      | —      | 3,403               | 1.77  | 0.0   | 45.00 | 4.9    | 4,827        | 141.83                      | 27  |       |
| 6                             | 2.50以上10.00未満   | —                        | —                                      | —      | —                   | —     | —     | —     | —      | —            | —                           | —   |       |
| 7                             | 10.00以上100.00未満 | —                        | —                                      | —      | —                   | —     | —     | —     | —      | —            | —                           | —   |       |
| 8                             | 100.00（デフォルト）   | —                        | —                                      | —      | —                   | —     | —     | —     | —      | —            | —                           | —   |       |
| 9                             | 小計              | 207,238                  | 127,416                                | 79.68  | 306,165             | 0.08  | 0.1   | 43.41 | 2.0    | 81,749       | 26.70                       | 122 | 81    |

(単位：百万円、%、千件、年)

| CR6                                                       |                 | 2020年9月末                                              |                                                                         |                |                                  |           |                    |                |                     |                           |                                                 |         |                |
|-----------------------------------------------------------|-----------------|-------------------------------------------------------|-------------------------------------------------------------------------|----------------|----------------------------------|-----------|--------------------|----------------|---------------------|---------------------------|-------------------------------------------------|---------|----------------|
| 項番                                                        | PD区分            | イ<br>オン・<br>バランス<br>シート・<br>グロス<br>エクスポ<br>ージャー<br>の額 | ロ<br>CCF・信用<br>リスク削減<br>手法適用前<br>のオフ・バ<br>ランスシ<br>ート・エクス<br>ポージャー<br>の額 | ハ<br>平均<br>CCF | ニ<br>CCF・信用<br>リスク削減<br>手法適用後EAD | ホ<br>平均PD | ヘ<br>債務<br>者の<br>数 | ト<br>平均<br>LGD | チ<br>平均<br>残存<br>期間 | リ<br>信用リスク<br>・アセット<br>の額 | ヌ<br>リスク・<br>ウェイトの<br>加重平均値<br>(RWA<br>density) | ル<br>EL | ヲ<br>適格<br>引当金 |
| 事業法人向けエクスポージャー（中堅中小企業向けエクスポージャー及び特定貸付債権を除く）（先進的内部格付手法適用分） |                 |                                                       |                                                                         |                |                                  |           |                    |                |                     |                           |                                                 |         |                |
| 1                                                         | 0.00以上0.15未満    | 6,977,953                                             | 2,947,999                                                               | 75.93          | 9,284,585                        | 0.07      | 0.6                | 31.50          | 2.5                 | 1,711,161                 | 18.43                                           | 2,224   |                |
| 2                                                         | 0.15以上0.25未満    | 2,055,069                                             | 494,358                                                                 | 74.57          | 2,389,757                        | 0.20      | 0.4                | 30.95          | 2.3                 | 764,570                   | 31.99                                           | 1,516   |                |
| 3                                                         | 0.25以上0.50未満    | 1,497,943                                             | 354,158                                                                 | 74.89          | 1,764,806                        | 0.30      | 0.5                | 31.27          | 2.2                 | 684,020                   | 38.75                                           | 1,703   |                |
| 4                                                         | 0.50以上0.75未満    | 1,113,836                                             | 245,850                                                                 | 76.72          | 1,290,029                        | 0.50      | 0.7                | 29.38          | 2.4                 | 586,096                   | 45.43                                           | 1,913   |                |
| 5                                                         | 0.75以上2.50未満    | 831,176                                               | 153,929                                                                 | 71.73          | 897,815                          | 1.50      | 0.7                | 28.57          | 2.0                 | 580,325                   | 64.63                                           | 3,884   |                |
| 6                                                         | 2.50以上10.00未満   | 155,851                                               | 7,328                                                                   | 84.10          | 162,548                          | 6.02      | 0.0                | 25.12          | 2.2                 | 140,785                   | 86.61                                           | 2,496   |                |
| 7                                                         | 10.00以上100.00未満 | 87,172                                                | 134                                                                     | 75.00          | 87,103                           | 18.67     | 0.0                | 31.68          | 3.4                 | 149,919                   | 172.11                                          | 5,155   |                |
| 8                                                         | 100.00（デフォルト）   | 30,663                                                | —                                                                       | —              | 36,386                           | 100.00    | 0.0                | 31.65          | 1.0                 | 14,747                    | 40.52                                           | 10,338  |                |
| 9                                                         | 小計              | 12,749,666                                            | 4,203,760                                                               | 75.59          | 15,913,031                       | 0.62      | 3.2                | 30.99          | 2.4                 | 4,631,625                 | 29.10                                           | 29,233  | 68,347         |
| 事業法人向けエクスポージャー（中堅中小企業向けエクスポージャー及び特定貸付債権を除く）（基礎的内部格付手法適用分） |                 |                                                       |                                                                         |                |                                  |           |                    |                |                     |                           |                                                 |         |                |
| 1                                                         | 0.00以上0.15未満    | 859,918                                               | 102,403                                                                 | 81.22          | 950,187                          | 0.07      | 0.8                | 53.81          | 3.0                 | 353,254                   | 37.17                                           | 375     |                |
| 2                                                         | 0.15以上0.25未満    | 55,782                                                | —                                                                       | —              | 55,939                           | 0.20      | 0.4                | 67.09          | 4.1                 | 52,024                    | 93.00                                           | 76      |                |
| 3                                                         | 0.25以上0.50未満    | 315,945                                               | 44,529                                                                  | 77.48          | 349,571                          | 0.29      | 0.5                | 46.53          | 2.3                 | 206,595                   | 59.09                                           | 479     |                |
| 4                                                         | 0.50以上0.75未満    | 156,899                                               | 28,771                                                                  | 75.22          | 178,841                          | 0.57      | 0.7                | 42.01          | 3.2                 | 140,542                   | 78.58                                           | 433     |                |
| 5                                                         | 0.75以上2.50未満    | 363,222                                               | 10,295                                                                  | 76.93          | 370,660                          | 1.43      | 1.1                | 44.21          | 3.8                 | 460,374                   | 124.20                                          | 2,346   |                |
| 6                                                         | 2.50以上10.00未満   | 125,264                                               | 4,755                                                                   | 91.70          | 130,010                          | 5.67      | 0.3                | 45.60          | 4.3                 | 237,388                   | 182.59                                          | 3,364   |                |
| 7                                                         | 10.00以上100.00未満 | 65,844                                                | —                                                                       | —              | 63,603                           | 27.36     | 0.0                | 44.77          | 3.9                 | 168,826                   | 265.43                                          | 7,787   |                |
| 8                                                         | 100.00（デフォルト）   | 28,075                                                | 230                                                                     | 0.00           | 32,043                           | 100.00    | 0.0                | 44.65          | 1.0                 | 0                         | 0.00                                            | 14,308  |                |
| 9                                                         | 小計              | 1,970,952                                             | 190,985                                                                 | 79.37          | 2,130,856                        | 3.05      | 4.2                | 49.40          | 3.2                 | 1,619,007                 | 75.97                                           | 29,171  | 15,469         |
| 中堅中小企業向けエクスポージャー（先進的内部格付手法適用分）                            |                 |                                                       |                                                                         |                |                                  |           |                    |                |                     |                           |                                                 |         |                |
| 1                                                         | 0.00以上0.15未満    | 69,393                                                | 3,996                                                                   | 75.00          | 70,665                           | 0.12      | 0.0                | 30.77          | 2.0                 | 13,300                    | 18.82                                           | 26      |                |
| 2                                                         | 0.15以上0.25未満    | 91,532                                                | —                                                                       | —              | 91,036                           | 0.20      | 0.0                | 31.79          | 3.2                 | 28,795                    | 31.63                                           | 59      |                |
| 3                                                         | 0.25以上0.50未満    | 22,191                                                | —                                                                       | —              | 22,191                           | 0.30      | 0.0                | 29.24          | 2.8                 | 6,969                     | 31.40                                           | 20      |                |
| 4                                                         | 0.50以上0.75未満    | 40,655                                                | 601                                                                     | 75.00          | 39,439                           | 0.50      | 0.0                | 23.45          | 2.5                 | 12,430                    | 31.51                                           | 46      |                |
| 5                                                         | 0.75以上2.50未満    | 115,275                                               | 10,186                                                                  | 78.56          | 118,022                          | 1.58      | 0.1                | 21.52          | 3.0                 | 55,557                    | 47.07                                           | 399     |                |
| 6                                                         | 2.50以上10.00未満   | 8,044                                                 | 518                                                                     | 75.87          | 8,437                            | 6.57      | 0.0                | 16.74          | 2.5                 | 4,116                     | 48.78                                           | 97      |                |
| 7                                                         | 10.00以上100.00未満 | 1,503                                                 | —                                                                       | —              | 794                              | 18.67     | 0.0                | 19.33          | 1.9                 | 612                       | 77.09                                           | 28      |                |
| 8                                                         | 100.00（デフォルト）   | 1,289                                                 | —                                                                       | —              | 2,798                            | 100.00    | 0.0                | 27.29          | 1.0                 | 967                       | 34.58                                           | 686     |                |
| 9                                                         | 小計              | 349,886                                               | 15,302                                                                  | 77.40          | 353,385                          | 1.67      | 0.3                | 26.64          | 2.7                 | 122,750                   | 34.73                                           | 1,364   | 2,673          |
| 中堅中小企業向けエクスポージャー（基礎的内部格付手法適用分）                            |                 |                                                       |                                                                         |                |                                  |           |                    |                |                     |                           |                                                 |         |                |
| 1                                                         | 0.00以上0.15未満    | 9                                                     | —                                                                       | —              | 9                                | 0.11      | 0.0                | 45.00          | 1.0                 | 1                         | 18.59                                           | 0       |                |
| 2                                                         | 0.15以上0.25未満    | 42                                                    | —                                                                       | —              | 42                               | 0.20      | 0.0                | 45.00          | 1.0                 | 11                        | 26.85                                           | 0       |                |
| 3                                                         | 0.25以上0.50未満    | 365                                                   | —                                                                       | —              | 365                              | 0.30      | 0.0                | 45.00          | 2.2                 | 176                       | 48.37                                           | 0       |                |
| 4                                                         | 0.50以上0.75未満    | 99,202                                                | 315                                                                     | 75.00          | 98,184                           | 0.50      | 0.5                | 38.11          | 4.6                 | 63,654                    | 64.83                                           | 188     |                |
| 5                                                         | 0.75以上2.50未満    | 285,436                                               | 1,724                                                                   | 82.20          | 284,320                          | 1.60      | 1.6                | 39.67          | 4.7                 | 265,110                   | 93.24                                           | 1,812   |                |
| 6                                                         | 2.50以上10.00未満   | 9,392                                                 | —                                                                       | —              | 9,394                            | 7.25      | 0.0                | 39.30          | 4.2                 | 11,819                    | 125.81                                          | 265     |                |
| 7                                                         | 10.00以上100.00未満 | 358                                                   | —                                                                       | —              | 358                              | 18.67     | 0.0                | 45.00          | 3.6                 | 713                       | 198.83                                          | 30      |                |
| 8                                                         | 100.00（デフォルト）   | 6,131                                                 | 294                                                                     | 39.81          | 6,430                            | 100.00    | 0.0                | 39.82          | 1.0                 | 0                         | 0.00                                            | 2,561   |                |
| 9                                                         | 小計              | 400,938                                               | 2,334                                                                   | 75.87          | 399,104                          | 3.06      | 2.3                | 39.29          | 4.6                 | 341,487                   | 85.56                                           | 4,858   | 548            |

三井住友トラスト・  
ホールディングス  
決算データ三井住友信託銀行  
決算データ三井住友トラスト・  
ホールディングス  
パーゼル川関連データ三井住友信託銀行  
パーゼル川関連データ

開示項目一覧

(単位：百万円、%、千件、年)

| CR6                                       |                 | 2020年9月末                                              |                                                                         |                |                                  |           |                    |                |                     |                           |                                                 |         |                |
|-------------------------------------------|-----------------|-------------------------------------------------------|-------------------------------------------------------------------------|----------------|----------------------------------|-----------|--------------------|----------------|---------------------|---------------------------|-------------------------------------------------|---------|----------------|
| 項番                                        | PD区分            | イ<br>オン・<br>バランス<br>シート・<br>グロス<br>エクスポ<br>ージャー<br>の額 | ロ<br>CCF・信用<br>リスク削減<br>手法適用前<br>のオフ・バ<br>ランスシ<br>ート・エクス<br>ポージャー<br>の額 | ハ<br>平均<br>CCF | ニ<br>CCF・信用<br>リスク削減<br>手法適用後EAD | ホ<br>平均PD | ヘ<br>債務<br>者の<br>数 | ト<br>平均<br>LGD | チ<br>平均<br>残存<br>期間 | リ<br>信用リスク<br>・アセット<br>の額 | ヌ<br>リスク・<br>ウェイトの<br>加重平均値<br>(RWA<br>density) | ル<br>EL | ヲ<br>適格<br>引当金 |
| 特定貸付債権（先進的内部格付手法適用分）                      |                 |                                                       |                                                                         |                |                                  |           |                    |                |                     |                           |                                                 |         |                |
| 1                                         | 0.00以上0.15未満    | 1,369,415                                             | 140,271                                                                 | 75.25          | 1,474,981                        | 0.08      | 0.3                | 27.12          | 4.3                 | 356,135                   | 24.14                                           | 360     |                |
| 2                                         | 0.15以上0.25未満    | 68,970                                                | 10,777                                                                  | 75.00          | 77,054                           | 0.20      | 0.0                | 28.52          | 3.3                 | 27,142                    | 35.22                                           | 45      |                |
| 3                                         | 0.25以上0.50未満    | 590,351                                               | 101,562                                                                 | 74.46          | 665,981                          | 0.29      | 0.1                | 23.97          | 4.3                 | 259,717                   | 38.99                                           | 474     |                |
| 4                                         | 0.50以上0.75未満    | 290,710                                               | 41,891                                                                  | 74.81          | 322,052                          | 0.57      | 0.0                | 21.47          | 4.3                 | 147,704                   | 45.86                                           | 407     |                |
| 5                                         | 0.75以上2.50未満    | 293,945                                               | 68,576                                                                  | 73.16          | 344,122                          | 1.44      | 0.0                | 26.57          | 3.8                 | 245,322                   | 71.28                                           | 1,350   |                |
| 6                                         | 2.50以上10.00未満   | 85,998                                                | 27,579                                                                  | 75.00          | 106,683                          | 4.57      | 0.0                | 28.87          | 3.3                 | 105,025                   | 98.44                                           | 1,349   |                |
| 7                                         | 10.00以上100.00未満 | 37,192                                                | 11,348                                                                  | 75.00          | 45,704                           | 32.03     | 0.0                | 40.11          | 4.0                 | 104,424                   | 228.48                                          | 6,089   |                |
| 8                                         | 100.00（デフォルト）   | 13,411                                                | —                                                                       | —              | 13,415                           | 100.00    | 0.0                | 26.49          | 1.0                 | 6,014                     | 44.83                                           | 3,073   |                |
| 9                                         | 小計              | 2,749,996                                             | 402,007                                                                 | 74.62          | 3,049,994                        | 1.41      | 0.7                | 26.06          | 4.1                 | 1,251,486                 | 41.03                                           | 13,149  | 7,761          |
| 特定貸付債権（基礎的内部格付手法適用分）                      |                 |                                                       |                                                                         |                |                                  |           |                    |                |                     |                           |                                                 |         |                |
| 1                                         | 0.00以上0.15未満    | 1,318                                                 | —                                                                       | —              | 1,318                            | 0.09      | 0.2                | 45.00          | 1.0                 | 234                       | 17.81                                           | 0       |                |
| 2                                         | 0.15以上0.25未満    | 48                                                    | —                                                                       | —              | 48                               | 0.20      | 0.0                | 45.00          | 1.0                 | 14                        | 30.51                                           | 0       |                |
| 3                                         | 0.25以上0.50未満    | 1,003                                                 | —                                                                       | —              | 1,003                            | 0.30      | 0.1                | 45.00          | 1.0                 | 389                       | 38.85                                           | 1       |                |
| 4                                         | 0.50以上0.75未満    | 321                                                   | —                                                                       | —              | 321                              | 0.63      | 0.0                | 45.00          | 1.0                 | 188                       | 58.76                                           | 0       |                |
| 5                                         | 0.75以上2.50未満    | 386                                                   | —                                                                       | —              | 386                              | 1.53      | 0.0                | 45.00          | 1.0                 | 331                       | 85.88                                           | 2       |                |
| 6                                         | 2.50以上10.00未満   | 59                                                    | —                                                                       | —              | 59                               | 4.88      | 0.0                | 45.00          | 1.0                 | 76                        | 129.37                                          | 1       |                |
| 7                                         | 10.00以上100.00未満 | 62                                                    | —                                                                       | —              | 62                               | 33.86     | 0.0                | 45.00          | 1.0                 | 144                       | 233.58                                          | 9       |                |
| 8                                         | 100.00（デフォルト）   | 23                                                    | —                                                                       | —              | 23                               | 100.00    | 0.0                | 45.00          | 1.0                 | 0                         | 0.00                                            | 10      |                |
| 9                                         | 小計              | 3,223                                                 | —                                                                       | —              | 3,223                            | 1.86      | 0.6                | 45.00          | 1.0                 | 1,381                     | 42.86                                           | 26      | —              |
| 株式等エクスポージャー（PD/LGD方式が適用されるエクスポージャーに限る）    |                 |                                                       |                                                                         |                |                                  |           |                    |                |                     |                           |                                                 |         |                |
| 1                                         | 0.00以上0.15未満    | 1,180,311                                             | —                                                                       | —              | 466,915                          | 0.07      | 0.3                | 90.00          | 5.0                 | 551,794                   | 118.17                                          | —       |                |
| 2                                         | 0.15以上0.25未満    | 118,904                                               | —                                                                       | —              | 50,690                           | 0.20      | 0.1                | 90.00          | 5.0                 | 75,745                    | 149.42                                          | —       |                |
| 3                                         | 0.25以上0.50未満    | 76,087                                                | —                                                                       | —              | 29,124                           | 0.30      | 0.2                | 90.00          | 5.0                 | 50,597                    | 173.72                                          | —       |                |
| 4                                         | 0.50以上0.75未満    | 38,730                                                | —                                                                       | —              | 20,397                           | 0.50      | 0.2                | 90.00          | 5.0                 | 41,264                    | 202.30                                          | —       |                |
| 5                                         | 0.75以上2.50未満    | 16,046                                                | —                                                                       | —              | 11,783                           | 1.44      | 0.2                | 90.00          | 5.0                 | 33,998                    | 288.52                                          | —       |                |
| 6                                         | 2.50以上10.00未満   | 3,462                                                 | —                                                                       | —              | 2,107                            | 6.76      | 0.0                | 90.00          | 5.0                 | 9,100                     | 431.90                                          | —       |                |
| 7                                         | 10.00以上100.00未満 | 0                                                     | —                                                                       | —              | 0                                | 18.68     | 0.0                | 90.00          | 5.0                 | 0                         | 724.60                                          | —       |                |
| 8                                         | 100.00（デフォルト）   | 99                                                    | —                                                                       | —              | 38                               | 100.00    | 0.0                | 90.00          | 5.0                 | 433                       | 1,125.00                                        | —       |                |
| 9                                         | 小計              | 1,433,642                                             | —                                                                       | —              | 581,057                          | 0.17      | 1.3                | 90.00          | 5.0                 | 762,935                   | 131.30                                          | —       |                |
| 購入債権（事業法人等向け）ーデフォルト・リスク相当部分（先進的内部格付手法適用分） |                 |                                                       |                                                                         |                |                                  |           |                    |                |                     |                           |                                                 |         |                |
| 1                                         | 0.00以上0.15未満    | 5,430                                                 | —                                                                       | —              | 5,430                            | 0.08      | 0.0                | 32.10          | 3.6                 | 1,459                     | 26.87                                           | 1       |                |
| 2                                         | 0.15以上0.25未満    | 20,625                                                | —                                                                       | —              | 20,625                           | 0.20      | 0.0                | 32.10          | 3.9                 | 8,605                     | 41.72                                           | 13      |                |
| 3                                         | 0.25以上0.50未満    | 7,307                                                 | 570                                                                     | 75.00          | 7,735                            | 0.30      | 0.0                | 32.10          | 2.4                 | 3,213                     | 41.54                                           | 7       |                |
| 4                                         | 0.50以上0.75未満    | 5,054                                                 | —                                                                       | —              | 5,054                            | 0.50      | 0.0                | 31.97          | 3.1                 | 2,775                     | 54.91                                           | 8       |                |
| 5                                         | 0.75以上2.50未満    | 27,094                                                | —                                                                       | —              | 27,094                           | 1.64      | 0.0                | 31.39          | 3.6                 | 23,509                    | 86.76                                           | 140     |                |
| 6                                         | 2.50以上10.00未満   | 480                                                   | —                                                                       | —              | 480                              | 7.65      | 0.0                | 32.10          | 4.3                 | 672                       | 140.12                                          | 11      |                |
| 7                                         | 10.00以上100.00未満 | 371                                                   | —                                                                       | —              | 371                              | 18.67     | 0.0                | 32.10          | 3.3                 | 647                       | 174.08                                          | 22      |                |
| 8                                         | 100.00（デフォルト）   | 2,309                                                 | —                                                                       | —              | 2,309                            | 100.00    | 0.0                | 32.10          | 1.0                 | 949                       | 41.12                                           | 665     |                |
| 9                                         | 小計              | 68,673                                                | 570                                                                     | 75.00          | 69,101                           | 4.28      | 0.0                | 31.81          | 3.5                 | 41,833                    | 60.53                                           | 870     | 192            |

(単位：百万円、%、千件、年)

| CR6                                                               |                 | 2020年9月末                 |                                        |       |                     |        |       |        |        |              |                              |       |       |
|-------------------------------------------------------------------|-----------------|--------------------------|----------------------------------------|-------|---------------------|--------|-------|--------|--------|--------------|------------------------------|-------|-------|
| 項番                                                                | PD区分            | オン・バランスシート・グロスエクスポージャーの額 | CCF・信用リスク削減手法適用前のオフ・バランスシート・エクスポージャーの額 | 平均CCF | CCF・信用リスク削減手法適用後EAD | 平均PD   | 債務者の数 | 平均LGD  | 平均残存期間 | 信用リスク・アセットの額 | リスク・ウェイトの加重平均値 (RWA density) | EL    | 適格引当金 |
| 購入債権（事業法人等向け）ー希薄化リスク相当部分及びローン・パーティシペーション原債権者リスク相当部分（先進的内部格付手法適用分） |                 |                          |                                        |       |                     |        |       |        |        |              |                              |       |       |
| 1                                                                 | 0.00以上0.15未満    | —                        | —                                      | —     | —                   | —      | —     | —      | —      | —            | —                            | —     |       |
| 2                                                                 | 0.15以上0.25未満    | 2,280                    | 570                                    | 75.00 | 2,707               | 0.22   | 0.0   | 100.00 | 1.0    | 1,962        | 72.47                        | —     |       |
| 3                                                                 | 0.25以上0.50未満    | —                        | —                                      | —     | —                   | —      | —     | —      | —      | —            | —                            | —     |       |
| 4                                                                 | 0.50以上0.75未満    | —                        | —                                      | —     | —                   | —      | —     | —      | —      | —            | —                            | —     |       |
| 5                                                                 | 0.75以上2.50未満    | —                        | —                                      | —     | —                   | —      | —     | —      | —      | —            | —                            | —     |       |
| 6                                                                 | 2.50以上10.00未満   | —                        | —                                      | —     | —                   | —      | —     | —      | —      | —            | —                            | —     |       |
| 7                                                                 | 10.00以上100.00未満 | —                        | —                                      | —     | —                   | —      | —     | —      | —      | —            | —                            | —     |       |
| 8                                                                 | 100.00（デフォルト）   | —                        | —                                      | —     | —                   | —      | —     | —      | —      | —            | —                            | —     |       |
| 9                                                                 | 小計              | 2,280                    | 570                                    | 75.00 | 2,707               | 0.22   | 0.0   | 100.00 | 1.0    | 1,962        | 72.47                        | —     | —     |
| 購入債権（事業法人等向け）ーデフォルト・リスク相当部分（基礎的内部格付手法適用分）                         |                 |                          |                                        |       |                     |        |       |        |        |              |                              |       |       |
| 1                                                                 | 0.00以上0.15未満    | 274,899                  | —                                      | —     | 274,899             | 0.05   | 0.2   | 45.00  | 1.1    | 36,860       | 13.40                        | 71    |       |
| 2                                                                 | 0.15以上0.25未満    | 65,519                   | 2,309                                  | 75.00 | 67,251              | 0.20   | 0.1   | 45.00  | 1.1    | 21,167       | 31.47                        | 62    |       |
| 3                                                                 | 0.25以上0.50未満    | 73,504                   | —                                      | —     | 73,504              | 0.30   | 0.1   | 45.00  | 1.1    | 29,767       | 40.49                        | 101   |       |
| 4                                                                 | 0.50以上0.75未満    | 27,212                   | 2,281                                  | 75.00 | 28,924              | 0.51   | 0.9   | 45.00  | 1.3    | 16,381       | 56.63                        | 67    |       |
| 5                                                                 | 0.75以上2.50未満    | 35,403                   | —                                      | —     | 35,403              | 1.49   | 3.4   | 45.00  | 1.5    | 30,391       | 85.84                        | 238   |       |
| 6                                                                 | 2.50以上10.00未満   | 5,162                    | —                                      | —     | 5,162               | 3.26   | 0.3   | 45.00  | 1.0    | 5,838        | 113.09                       | 75    |       |
| 7                                                                 | 10.00以上100.00未満 | 177                      | —                                      | —     | 177                 | 34.71  | 0.0   | 45.00  | 4.9    | 469          | 265.28                       | 27    |       |
| 8                                                                 | 100.00（デフォルト）   | 3,930                    | —                                      | —     | 3,930               | 100.00 | 0.0   | 45.00  | 1.0    | 0            | 0.00                         | 1,768 |       |
| 9                                                                 | 小計              | 485,810                  | 4,591                                  | 75.00 | 489,253             | 1.09   | 5.2   | 45.00  | 1.1    | 140,877      | 28.79                        | 2,414 | 471   |
| 購入債権（事業法人等向け）ー希薄化リスク相当部分及びローン・パーティシペーション原債権者リスク相当部分（基礎的内部格付手法適用分） |                 |                          |                                        |       |                     |        |       |        |        |              |                              |       |       |
| 1                                                                 | 0.00以上0.15未満    | 347,810                  | 2,281                                  | 75.00 | 349,521             | 0.05   | 0.1   | 90.39  | 1.1    | 85,533       | 24.47                        | 14    |       |
| 2                                                                 | 0.15以上0.25未満    | 13,441                   | 2,309                                  | 75.00 | 15,173              | 0.21   | 0.0   | 77.02  | 1.3    | 8,660        | 57.07                        | 5     |       |
| 3                                                                 | 0.25以上0.50未満    | 29,734                   | —                                      | —     | 29,734              | 0.35   | 0.1   | 68.32  | 1.1    | 20,820       | 70.02                        | 20    |       |
| 4                                                                 | 0.50以上0.75未満    | 1,994                    | —                                      | —     | 1,994               | 0.50   | 0.0   | 45.00  | 4.2    | 1,908        | 95.66                        | 4     |       |
| 5                                                                 | 0.75以上2.50未満    | 6,185                    | —                                      | —     | 6,185               | 0.87   | 0.1   | 97.37  | 1.1    | 9,284        | 150.09                       | 2     |       |
| 6                                                                 | 2.50以上10.00未満   | —                        | —                                      | —     | —                   | —      | —     | —      | —      | —            | —                            | —     |       |
| 7                                                                 | 10.00以上100.00未満 | —                        | —                                      | —     | —                   | —      | —     | —      | —      | —            | —                            | —     |       |
| 8                                                                 | 100.00（デフォルト）   | —                        | —                                      | —     | —                   | —      | —     | —      | —      | —            | —                            | —     |       |
| 9                                                                 | 小計              | 399,165                  | 4,591                                  | 75.00 | 402,609             | 0.09   | 0.5   | 88.14  | 1.1    | 126,206      | 31.34                        | 48    | —     |
| 購入債権（リテール向け）ーデフォルト・リスク相当部分                                        |                 |                          |                                        |       |                     |        |       |        |        |              |                              |       |       |
| 1                                                                 | 0.00以上0.15未満    | —                        | —                                      | —     | —                   | —      | —     | —      | —      | —            | —                            | —     |       |
| 2                                                                 | 0.15以上0.25未満    | —                        | —                                      | —     | —                   | —      | —     | —      | —      | —            | —                            | —     |       |
| 3                                                                 | 0.25以上0.50未満    | 51,853                   | —                                      | —     | 51,853              | 0.30   | 34.4  | 74.33  | —      | 20,782       | 40.08                        | 119   |       |
| 4                                                                 | 0.50以上0.75未満    | —                        | —                                      | —     | —                   | —      | —     | —      | —      | —            | —                            | —     |       |
| 5                                                                 | 0.75以上2.50未満    | —                        | —                                      | —     | —                   | —      | —     | —      | —      | —            | —                            | —     |       |
| 6                                                                 | 2.50以上10.00未満   | —                        | —                                      | —     | —                   | —      | —     | —      | —      | —            | —                            | —     |       |
| 7                                                                 | 10.00以上100.00未満 | —                        | —                                      | —     | —                   | —      | —     | —      | —      | —            | —                            | —     |       |
| 8                                                                 | 100.00（デフォルト）   | —                        | —                                      | —     | —                   | —      | —     | —      | —      | —            | —                            | —     |       |
| 9                                                                 | 小計              | 51,853                   | —                                      | —     | 51,853              | 0.30   | 34.4  | 74.33  | —      | 20,782       | 40.08                        | 119   | 191   |

三井住友トラスト・ホールディングス  
決算データ三井住友信託銀行  
決算データ三井住友トラスト・ホールディングス  
パーゼル川関連データ三井住友信託銀行  
パーゼル川関連データ

開示項目一覧

(単位：百万円、%、千件、年)

| CR6                     |                 | 2020年9月末                                              |                                                                             |                |                                      |           |                    |                |                     |                               |                                                     |         |                |
|-------------------------|-----------------|-------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------------------|-----------|--------------------|----------------|---------------------|-------------------------------|-----------------------------------------------------|---------|----------------|
| 項番                      | PD区分            | イ<br>オン・<br>バランス<br>シート・<br>グロス<br>エクスポ<br>ージャー<br>の額 | ロ<br>CCF・信用<br>リスク削減<br>手法適用前<br>のオフ・バ<br>ランスシ<br>ート・エク<br>スポー<br>ジャー<br>の額 | ハ<br>平均<br>CCF | ニ<br>CCF・信用<br>リスク削減<br>手法適用<br>後EAD | ホ<br>平均PD | ヘ<br>債務<br>者の<br>数 | ト<br>平均<br>LGD | チ<br>平均<br>残存<br>期間 | リ<br>信用リス<br>ク・アセ<br>ットの<br>額 | ヌ<br>リスク・<br>ウェイト<br>の加重<br>平均値<br>(RWA<br>density) | ル<br>EL | ヲ<br>適格<br>引当金 |
| 適格リボルビング型リテール向けエクスポージャー |                 |                                                       |                                                                             |                |                                      |           |                    |                |                     |                               |                                                     |         |                |
| 1                       | 0.00以上0.15未満    | 0                                                     | 42,224                                                                      | 28.14          | 11,883                               | 0.10      | 44.5               | 62.59          | —                   | 482                           | 4.05                                                | 8       |                |
| 2                       | 0.15以上0.25未満    | 37,275                                                | 822,865                                                                     | 12.66          | 141,524                              | 0.23      | 201.8              | 66.45          | —                   | 11,555                        | 8.16                                                | 223     |                |
| 3                       | 0.25以上0.50未満    | 21,056                                                | 861,762                                                                     | 7.91           | 89,230                               | 0.36      | 152.6              | 75.32          | —                   | 11,621                        | 13.02                                               | 243     |                |
| 4                       | 0.50以上0.75未満    | 30,214                                                | 260,775                                                                     | 12.66          | 63,251                               | 0.57      | 83.1               | 66.45          | —                   | 10,406                        | 16.45                                               | 239     |                |
| 5                       | 0.75以上2.50未満    | 12,480                                                | 209,469                                                                     | 13.54          | 40,859                               | 1.17      | 118.2              | 67.62          | —                   | 11,616                        | 28.42                                               | 322     |                |
| 6                       | 2.50以上10.00未満   | 32,904                                                | 75,086                                                                      | 13.44          | 42,997                               | 4.90      | 43.6               | 66.91          | —                   | 32,836                        | 76.36                                               | 1,412   |                |
| 7                       | 10.00以上100.00未満 | 235                                                   | 1,165                                                                       | 13.74          | 395                                  | 46.99     | 0.6                | 65.83          | —                   | 678                           | 171.52                                              | 125     |                |
| 8                       | 100.00 (デフォルト)  | 71                                                    | 4,318                                                                       | 8.92           | 16,158                               | 100.00    | 19.3               | 67.43          | —                   | 15,669                        | 96.97                                               | 9,643   |                |
| 9                       | 小計              | 134,238                                               | 2,277,668                                                                   | 11.25          | 406,301                              | 4.91      | 664.0              | 68.49          | —                   | 94,867                        | 23.34                                               | 12,219  | 17,747         |
| 居住用不動産向けエクスポージャー        |                 |                                                       |                                                                             |                |                                      |           |                    |                |                     |                               |                                                     |         |                |
| 1                       | 0.00以上0.15未満    | 3,912,966                                             | 14,686                                                                      | 100.00         | 3,927,653                            | 0.09      | 130.8              | 18.38          | —                   | 168,759                       | 4.29                                                | 712     |                |
| 2                       | 0.15以上0.25未満    | 2,923,688                                             | 43                                                                          | 100.00         | 2,923,732                            | 0.17      | 138.0              | 18.16          | —                   | 193,605                       | 6.62                                                | 935     |                |
| 3                       | 0.25以上0.50未満    | 2,883,704                                             | 1,886                                                                       | 100.00         | 2,885,600                            | 0.35      | 173.0              | 18.03          | —                   | 313,921                       | 10.87                                               | 1,833   |                |
| 4                       | 0.50以上0.75未満    | 39,732                                                | —                                                                           | —              | 39,732                               | 0.62      | 2.6                | 22.43          | —                   | 8,133                         | 20.47                                               | 55      |                |
| 5                       | 0.75以上2.50未満    | 134,580                                               | 19                                                                          | 100.00         | 134,599                              | 0.89      | 13.5               | 21.19          | —                   | 32,953                        | 24.48                                               | 252     |                |
| 6                       | 2.50以上10.00未満   | —                                                     | —                                                                           | —              | —                                    | —         | —                  | —              | —                   | —                             | —                                                   | —       |                |
| 7                       | 10.00以上100.00未満 | 68,496                                                | 5                                                                           | 100.00         | 68,502                               | 20.12     | 3.8                | 18.74          | —                   | 71,723                        | 104.70                                              | 2,610   |                |
| 8                       | 100.00 (デフォルト)  | 33,688                                                | 22                                                                          | 100.00         | 35,085                               | 100.00    | 1.9                | 20.16          | —                   | 8,556                         | 24.38                                               | 6,389   |                |
| 9                       | 小計              | 9,996,857                                             | 16,663                                                                      | 100.00         | 10,014,906                           | 0.69      | 464.0              | 18.28          | —                   | 797,652                       | 7.96                                                | 12,789  | 25,494         |
| その他リテール向けエクスポージャー       |                 |                                                       |                                                                             |                |                                      |           |                    |                |                     |                               |                                                     |         |                |
| 1                       | 0.00以上0.15未満    | 0                                                     | 23,303                                                                      | 22.70          | 5,290                                | 0.10      | 21.1               | 21.87          | —                   | 306                           | 5.79                                                | 1       |                |
| 2                       | 0.15以上0.25未満    | 14,810                                                | —                                                                           | —              | 14,810                               | 0.18      | 1.6                | 43.63          | —                   | 2,455                         | 16.57                                               | 11      |                |
| 3                       | 0.25以上0.50未満    | 346,697                                               | —                                                                           | —              | 346,697                              | 0.32      | 118.7              | 52.47          | —                   | 98,710                        | 28.47                                               | 579     |                |
| 4                       | 0.50以上0.75未満    | 328,808                                               | 350                                                                         | 100.00         | 329,456                              | 0.57      | 89.5               | 36.17          | —                   | 94,245                        | 28.60                                               | 710     |                |
| 5                       | 0.75以上2.50未満    | 176,598                                               | 140,920                                                                     | 28.26          | 216,432                              | 1.21      | 278.9              | 64.24          | —                   | 150,758                       | 69.65                                               | 1,772   |                |
| 6                       | 2.50以上10.00未満   | 24,547                                                | 25,376                                                                      | 58.23          | 39,325                               | 4.34      | 44.3               | 29.59          | —                   | 17,244                        | 43.85                                               | 592     |                |
| 7                       | 10.00以上100.00未満 | 17,828                                                | 574                                                                         | 86.75          | 18,383                               | 15.06     | 1.4                | 32.48          | —                   | 10,736                        | 58.40                                               | 1,022   |                |
| 8                       | 100.00 (デフォルト)  | 10,474                                                | 1,732                                                                       | 31.85          | 23,391                               | 100.00    | 12.6               | 48.48          | —                   | 5,967                         | 25.51                                               | 10,863  |                |
| 9                       | 小計              | 919,766                                               | 192,258                                                                     | 31.88          | 993,787                              | 3.37      | 568.5              | 47.97          | —                   | 380,425                       | 38.28                                               | 15,553  | 19,061         |
| リース取引（基礎的内部格付手法適用分）     |                 |                                                       |                                                                             |                |                                      |           |                    |                |                     |                               |                                                     |         |                |
| 1                       | 0.00以上0.15未満    | 195,749                                               | —                                                                           | —              | 195,749                              | 0.07      | 0.4                | 45.00          | 2.6                 | 48,414                        | 24.73                                               | 69      |                |
| 2                       | 0.15以上0.25未満    | 140,005                                               | —                                                                           | —              | 140,005                              | 0.20      | 0.1                | 45.00          | 4.1                 | 83,418                        | 59.58                                               | 129     |                |
| 3                       | 0.25以上0.50未満    | 23,418                                                | —                                                                           | —              | 23,418                               | 0.30      | 0.1                | 45.00          | 2.4                 | 12,755                        | 54.46                                               | 32      |                |
| 4                       | 0.50以上0.75未満    | 38,209                                                | —                                                                           | —              | 38,209                               | 0.50      | 0.2                | 45.00          | 3.0                 | 28,934                        | 75.72                                               | 86      |                |
| 5                       | 0.75以上2.50未満    | 39,917                                                | —                                                                           | —              | 39,917                               | 1.60      | 0.3                | 45.00          | 2.9                 | 42,062                        | 105.37                                              | 288     |                |
| 6                       | 2.50以上10.00未満   | 4,117                                                 | —                                                                           | —              | 4,117                                | 5.86      | 0.0                | 45.00          | 3.6                 | 6,466                         | 157.06                                              | 108     |                |
| 7                       | 10.00以上100.00未満 | 332                                                   | —                                                                           | —              | 332                                  | 18.67     | 0.0                | 45.00          | 3.0                 | 661                           | 199.03                                              | 27      |                |
| 8                       | 100.00 (デフォルト)  | —                                                     | —                                                                           | —              | 225                                  | 100.00    | 0.0                | 45.00          | 1.0                 | 0                             | 0.00                                                | 101     |                |
| 9                       | 小計              | 441,749                                               | —                                                                           | —              | 441,974                              | 0.42      | 1.3                | 45.00          | 3.1                 | 222,713                       | 50.39                                               | 844     | 5,085          |
| 合計（全てのポートフォリオ）          |                 | 52,964,751                                            | 7,547,529                                                                   | 55.27          | 56,331,730                           | 0.64      | 1,751.4            | 35.56          | 2.0                 | 10,881,169                    | 19.31                                               | 123,147 | 163,629        |

(注) 1. ヘ欄「債務者の数」：「適格リボルビング型リテール向けエクスポージャー」、「居住用不動産向けエクスポージャー」及び「その他リテール向けエクスポージャー」については、一部債務者数の把握が困難であることから、債権数で集計しております。  
 2. 購入債権（リテール向け）の希薄化リスク相当部分及びローン・パーティシパシオン原債権者リスク相当部分は該当ありません。

三井住友トラスト・ホールディングス  
決算データ三井住友信託銀行  
決算データ三井住友トラスト・ホールディングス  
パーゼラル川関連データ三井住友信託銀行  
パーゼラル川関連データ

開示項目一覧

(単位：百万円、%、千件、年)

| CR6                           |                 | 2019年9月末                                         |                                                                    |           |                                 |      |               |           |                |                      |                                            |     |           |
|-------------------------------|-----------------|--------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------|-----------|---------------------------------|------|---------------|-----------|----------------|----------------------|--------------------------------------------|-----|-----------|
|                               |                 | イ                                                | ロ                                                                  | ハ         | ニ                               | ホ    | ヘ             | ト         | チ              | リ                    | ヌ                                          | ル   | ヲ         |
| 項番                            | PD区分            | オン・<br>バランス<br>シート・<br>グロス<br>エクスポ<br>ージャー<br>の額 | CCF・信用<br>リスク削減<br>手法適用前<br>のオフ・バ<br>ランスシ<br>ート・エクス<br>ポージャー<br>の額 | 平均<br>CCF | CCF・<br>信用リスク<br>削減手法<br>適用後EAD | 平均PD | 債務<br>者の<br>数 | 平均<br>LGD | 平均<br>残存<br>期間 | 信用リスク<br>・アセット<br>の額 | リスク・<br>ウェイトの<br>加重平均値<br>(RWA<br>density) | EL  | 適格<br>引当金 |
| ソブリン向けエクスポージャー（先進的内部格付手法適用分）  |                 |                                                  |                                                                    |           |                                 |      |               |           |                |                      |                                            |     |           |
| 1                             | 0.00以上0.15未満    | 1,309,660                                        | 33                                                                 | 75.00     | 1,326,377                       | 0.00 | 0.0           | 32.52     | 2.0            | 16,526               | 1.24                                       | 9   |           |
| 2                             | 0.15以上0.25未満    | 4,661                                            | 1,020                                                              | 75.00     | 480                             | 0.20 | 0.0           | 31.78     | 4.5            | 216                  | 45.12                                      | 0   |           |
| 3                             | 0.25以上0.50未満    | —                                                | —                                                                  | —         | —                               | —    | —             | —         | —              | —                    | —                                          | —   |           |
| 4                             | 0.50以上0.75未満    | —                                                | —                                                                  | —         | —                               | —    | —             | —         | —              | —                    | —                                          | —   |           |
| 5                             | 0.75以上2.50未満    | —                                                | —                                                                  | —         | —                               | —    | —             | —         | —              | —                    | —                                          | —   |           |
| 6                             | 2.50以上10.00未満   | —                                                | —                                                                  | —         | —                               | —    | —             | —         | —              | —                    | —                                          | —   |           |
| 7                             | 10.00以上100.00未満 | —                                                | —                                                                  | —         | —                               | —    | —             | —         | —              | —                    | —                                          | —   |           |
| 8                             | 100.00（デフォルト）   | —                                                | —                                                                  | —         | —                               | —    | —             | —         | —              | —                    | —                                          | —   |           |
| 9                             | 小計              | 1,314,322                                        | 1,053                                                              | 75.00     | 1,326,858                       | 0.00 | 0.0           | 32.52     | 2.0            | 16,743               | 1.26                                       | 9   | 68        |
| ソブリン向けエクスポージャー（基礎的内部格付手法適用分）  |                 |                                                  |                                                                    |           |                                 |      |               |           |                |                      |                                            |     |           |
| 1                             | 0.00以上0.15未満    | 16,180,247                                       | 152,029                                                            | 92.94     | 16,381,632                      | 0.00 | 0.0           | 44.99     | 1.1            | 76,254               | 0.46                                       | 114 |           |
| 2                             | 0.15以上0.25未満    | 0                                                | —                                                                  | —         | 0                               | 0.20 | 0.0           | 45.00     | 1.0            | 0                    | 30.51                                      | 0   |           |
| 3                             | 0.25以上0.50未満    | 57,954                                           | 4,262                                                              | 75.00     | 26,094                          | 0.28 | 0.0           | 43.27     | 2.2            | 15,807               | 60.57                                      | 31  |           |
| 4                             | 0.50以上0.75未満    | —                                                | —                                                                  | —         | —                               | —    | —             | —         | —              | —                    | —                                          | —   |           |
| 5                             | 0.75以上2.50未満    | 2,343                                            | —                                                                  | —         | 2,245                           | 1.77 | 0.0           | 45.00     | 1.0            | 2,063                | 91.89                                      | 17  |           |
| 6                             | 2.50以上10.00未満   | 28,041                                           | —                                                                  | —         | 841                             | 5.63 | 0.0           | 45.00     | 2.4            | 1,284                | 152.65                                     | 21  |           |
| 7                             | 10.00以上100.00未満 | —                                                | —                                                                  | —         | —                               | —    | —             | —         | —              | —                    | —                                          | —   |           |
| 8                             | 100.00（デフォルト）   | —                                                | —                                                                  | —         | —                               | —    | —             | —         | —              | —                    | —                                          | —   |           |
| 9                             | 小計              | 16,268,587                                       | 156,292                                                            | 92.45     | 16,410,815                      | 0.00 | 0.1           | 44.99     | 1.1            | 95,410               | 0.58                                       | 185 | 519       |
| 金融機関等向けエクスポージャー（先進的内部格付手法適用分） |                 |                                                  |                                                                    |           |                                 |      |               |           |                |                      |                                            |     |           |
| 1                             | 0.00以上0.15未満    | 434,018                                          | 830                                                                | 75.00     | 435,377                         | 0.04 | 0.0           | 32.53     | 3.2            | 99,621               | 22.88                                      | 69  |           |
| 2                             | 0.15以上0.25未満    | 25,000                                           | 9,000                                                              | 75.00     | 31,750                          | 0.20 | 0.0           | 32.53     | 1.3            | 7,712                | 24.29                                      | 21  |           |
| 3                             | 0.25以上0.50未満    | 1,079                                            | —                                                                  | —         | 1,079                           | 0.30 | 0.0           | 11.99     | 1.0            | 113                  | 10.53                                      | 0   |           |
| 4                             | 0.50以上0.75未満    | 1,400                                            | 1,000                                                              | 75.00     | 2,150                           | 0.50 | 0.0           | 32.53     | 1.0            | 815                  | 37.91                                      | 3   |           |
| 5                             | 0.75以上2.50未満    | 16,784                                           | 4,176                                                              | 95.05     | 20,753                          | 1.12 | 0.0           | 32.53     | 1.0            | 11,642               | 56.09                                      | 76  |           |
| 6                             | 2.50以上10.00未満   | —                                                | —                                                                  | —         | —                               | —    | —             | —         | —              | —                    | —                                          | —   |           |
| 7                             | 10.00以上100.00未満 | —                                                | —                                                                  | —         | —                               | —    | —             | —         | —              | —                    | —                                          | —   |           |
| 8                             | 100.00（デフォルト）   | —                                                | —                                                                  | —         | —                               | —    | —             | —         | —              | —                    | —                                          | —   |           |
| 9                             | 小計              | 478,281                                          | 15,006                                                             | 80.58     | 491,110                         | 0.10 | 0.0           | 32.48     | 3.0            | 119,905              | 24.41                                      | 171 | 324       |
| 金融機関等向けエクスポージャー（基礎的内部格付手法適用分） |                 |                                                  |                                                                    |           |                                 |      |               |           |                |                      |                                            |     |           |
| 1                             | 0.00以上0.15未満    | 618,846                                          | 120,395                                                            | 80.76     | 715,896                         | 0.06 | 0.1           | 44.37     | 2.0            | 159,427              | 22.26                                      | 198 |           |
| 2                             | 0.15以上0.25未満    | 536                                              | —                                                                  | —         | 536                             | 0.20 | 0.0           | 72.94     | 1.0            | 265                  | 49.46                                      | 0   |           |
| 3                             | 0.25以上0.50未満    | 11,778                                           | 4,197                                                              | 75.00     | 12,426                          | 0.28 | 0.0           | 45.00     | 2.3            | 8,361                | 67.28                                      | 15  |           |
| 4                             | 0.50以上0.75未満    | 0                                                | —                                                                  | —         | 0                               | 0.50 | 0.0           | 45.00     | 1.0            | 0                    | 52.44                                      | 0   |           |
| 5                             | 0.75以上2.50未満    | 3,937                                            | —                                                                  | —         | 3,937                           | 1.77 | 0.0           | 45.00     | 4.9            | 5,582                | 141.76                                     | 31  |           |
| 6                             | 2.50以上10.00未満   | —                                                | —                                                                  | —         | —                               | —    | —             | —         | —              | —                    | —                                          | —   |           |
| 7                             | 10.00以上100.00未満 | —                                                | —                                                                  | —         | —                               | —    | —             | —         | —              | —                    | —                                          | —   |           |
| 8                             | 100.00（デフォルト）   | —                                                | —                                                                  | —         | —                               | —    | —             | —         | —              | —                    | —                                          | —   |           |
| 9                             | 小計              | 635,099                                          | 124,592                                                            | 80.56     | 732,798                         | 0.07 | 0.1           | 44.41     | 2.0            | 173,637              | 23.69                                      | 246 | 192       |

三井住友トラスト・  
ホールディングス  
決算データ三井住友信託銀行  
決算データ三井住友トラスト・  
ホールディングス・  
パーセル川関連データ三井住友信託銀行  
パーセル川関連データ

開示項目一覧

(単位：百万円、%、千件、年)

| CR6                                                       |                 | 2019年9月末                                         |                                                                    |           |                                 |        |               |           |                |                      |                                            |        |           |
|-----------------------------------------------------------|-----------------|--------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------|-----------|---------------------------------|--------|---------------|-----------|----------------|----------------------|--------------------------------------------|--------|-----------|
|                                                           |                 | イ                                                | ロ                                                                  | ハ         | ニ                               | ホ      | ヘ             | ト         | チ              | リ                    | ヌ                                          | ル      | ヲ         |
| 項番                                                        | PD区分            | オン・<br>バランス<br>シート・<br>グロス<br>エクスポ<br>ージャー<br>の額 | CCF・信用<br>リスク削減<br>手法適用前<br>のオフ・バ<br>ランスシ<br>ート・エクス<br>ポージャー<br>の額 | 平均<br>CCF | CCF・<br>信用リスク<br>削減手法<br>適用後EAD | 平均PD   | 債務<br>者の<br>数 | 平均<br>LGD | 平均<br>残存<br>期間 | 信用リスク<br>・アセット<br>の額 | リスク・<br>ウェイトの<br>加重平均値<br>(RWA<br>density) | EL     | 適格<br>引当金 |
| 事業法人向けエクスポージャー（中堅中小企業向けエクスポージャー及び特定貸付債権を除く）（先進的内部格付手法適用分） |                 |                                                  |                                                                    |           |                                 |        |               |           |                |                      |                                            |        |           |
| 1                                                         | 0.00以上0.15未満    | 6,561,453                                        | 2,446,763                                                          | 76.29     | 8,513,915                       | 0.07   | 0.7           | 31.92     | 2.6            | 1,661,526            | 19.51                                      | 2,085  |           |
| 2                                                         | 0.15以上0.25未満    | 2,041,192                                        | 403,579                                                            | 76.10     | 2,304,960                       | 0.20   | 0.4           | 31.19     | 2.5            | 753,715              | 32.69                                      | 1,474  |           |
| 3                                                         | 0.25以上0.50未満    | 1,366,693                                        | 186,818                                                            | 74.72     | 1,518,540                       | 0.30   | 0.5           | 31.50     | 2.6            | 636,472              | 41.91                                      | 1,475  |           |
| 4                                                         | 0.50以上0.75未満    | 1,023,722                                        | 191,255                                                            | 75.80     | 1,161,642                       | 0.50   | 0.7           | 28.65     | 2.5            | 517,482              | 44.54                                      | 1,680  |           |
| 5                                                         | 0.75以上2.50未満    | 846,216                                          | 131,116                                                            | 71.01     | 895,979                         | 1.45   | 0.7           | 28.94     | 2.2            | 594,197              | 66.31                                      | 3,786  |           |
| 6                                                         | 2.50以上10.00未満   | 144,789                                          | 7,477                                                              | 83.47     | 151,241                         | 5.97   | 0.0           | 24.97     | 2.5            | 133,499              | 88.26                                      | 2,278  |           |
| 7                                                         | 10.00以上100.00未満 | 25,855                                           | 37                                                                 | 75.00     | 25,733                          | 18.67  | 0.0           | 28.46     | 2.0            | 37,050               | 143.97                                     | 1,368  |           |
| 8                                                         | 100.00（デフォルト）   | 43,582                                           | 199                                                                | 75.00     | 47,887                          | 100.00 | 0.0           | 32.50     | 1.0            | 22,042               | 46.02                                      | 13,800 |           |
| 9                                                         | 小計              | 12,053,505                                       | 3,367,248                                                          | 75.96     | 14,619,903                      | 0.66   | 3.3           | 31.24     | 2.5            | 4,355,986            | 29.79                                      | 27,949 | 39,672    |
| 事業法人向けエクスポージャー（中堅中小企業向けエクスポージャー及び特定貸付債権を除く）（基礎的内部格付手法適用分） |                 |                                                  |                                                                    |           |                                 |        |               |           |                |                      |                                            |        |           |
| 1                                                         | 0.00以上0.15未満    | 780,124                                          | 106,575                                                            | 82.94     | 879,799                         | 0.07   | 0.8           | 52.98     | 3.1            | 337,121              | 38.31                                      | 350    |           |
| 2                                                         | 0.15以上0.25未満    | 60,674                                           | 145                                                                | 100.00    | 60,976                          | 0.20   | 0.4           | 65.24     | 3.9            | 54,655               | 89.63                                      | 81     |           |
| 3                                                         | 0.25以上0.50未満    | 316,608                                          | 66,255                                                             | 77.65     | 366,878                         | 0.29   | 0.5           | 46.46     | 2.6            | 237,023              | 64.60                                      | 505    |           |
| 4                                                         | 0.50以上0.75未満    | 179,067                                          | 11,859                                                             | 75.99     | 188,862                         | 0.58   | 0.8           | 42.08     | 3.6            | 161,554              | 85.54                                      | 472    |           |
| 5                                                         | 0.75以上2.50未満    | 367,459                                          | 30,111                                                             | 74.45     | 389,436                         | 1.40   | 1.2           | 44.10     | 3.8            | 476,221              | 122.28                                     | 2,400  |           |
| 6                                                         | 2.50以上10.00未満   | 149,731                                          | 10,856                                                             | 98.95     | 160,415                         | 5.57   | 0.3           | 45.09     | 4.3            | 288,672              | 179.95                                     | 4,015  |           |
| 7                                                         | 10.00以上100.00未満 | 36,568                                           | —                                                                  | —         | 34,662                          | 30.96  | 0.0           | 44.56     | 4.0            | 91,188               | 263.07                                     | 4,786  |           |
| 8                                                         | 100.00（デフォルト）   | 11,128                                           | 123                                                                | 0.00      | 13,607                          | 100.00 | 0.0           | 44.25     | 1.0            | 0                    | 0.00                                       | 6,022  |           |
| 9                                                         | 小計              | 1,901,363                                        | 225,926                                                            | 80.63     | 2,094,639                       | 1.99   | 4.3           | 48.76     | 3.3            | 1,646,436            | 78.60                                      | 18,635 | 10,725    |
| 中堅中小企業向けエクスポージャー（先進的内部格付手法適用分）                            |                 |                                                  |                                                                    |           |                                 |        |               |           |                |                      |                                            |        |           |
| 1                                                         | 0.00以上0.15未満    | 61,206                                           | 5,500                                                              | 75.00     | 65,331                          | 0.11   | 0.0           | 30.84     | 3.7            | 17,346               | 26.55                                      | 23     |           |
| 2                                                         | 0.15以上0.25未満    | 79,831                                           | 1,723                                                              | 75.00     | 77,248                          | 0.20   | 0.0           | 32.08     | 3.5            | 26,552               | 34.37                                      | 50     |           |
| 3                                                         | 0.25以上0.50未満    | 24,536                                           | —                                                                  | —         | 24,536                          | 0.30   | 0.0           | 30.59     | 2.0            | 6,855                | 27.93                                      | 23     |           |
| 4                                                         | 0.50以上0.75未満    | 45,579                                           | 319                                                                | 75.00     | 44,193                          | 0.50   | 0.0           | 21.71     | 2.5            | 12,794               | 28.95                                      | 48     |           |
| 5                                                         | 0.75以上2.50未満    | 99,639                                           | 10,148                                                             | 76.70     | 99,515                          | 1.54   | 0.1           | 21.78     | 2.7            | 45,607               | 45.82                                      | 330    |           |
| 6                                                         | 2.50以上10.00未満   | 15,516                                           | 671                                                                | 75.98     | 16,026                          | 6.61   | 0.0           | 19.31     | 2.7            | 8,954                | 55.86                                      | 214    |           |
| 7                                                         | 10.00以上100.00未満 | 3,923                                            | —                                                                  | —         | 3,189                           | 18.67  | 0.0           | 16.76     | 1.3            | 2,111                | 66.21                                      | 99     |           |
| 8                                                         | 100.00（デフォルト）   | 1,437                                            | —                                                                  | —         | 2,275                           | 100.00 | 0.0           | 28.08     | 1.0            | 897                  | 39.44                                      | 567    |           |
| 9                                                         | 小計              | 331,670                                          | 18,362                                                             | 75.97     | 332,318                         | 1.80   | 0.3           | 26.47     | 3.0            | 121,120              | 36.44                                      | 1,358  | 3,020     |
| 中堅中小企業向けエクスポージャー（基礎的内部格付手法適用分）                            |                 |                                                  |                                                                    |           |                                 |        |               |           |                |                      |                                            |        |           |
| 1                                                         | 0.00以上0.15未満    | 62                                               | —                                                                  | —         | 62                              | 0.12   | 0.0           | 45.00     | 1.0            | 12                   | 20.69                                      | 0      |           |
| 2                                                         | 0.15以上0.25未満    | 48                                               | —                                                                  | —         | 48                              | 0.20   | 0.0           | 45.00     | 1.0            | 12                   | 26.94                                      | 0      |           |
| 3                                                         | 0.25以上0.50未満    | 2                                                | —                                                                  | —         | 2                               | 0.30   | 0.0           | 45.00     | 1.0            | 0                    | 34.84                                      | 0      |           |
| 4                                                         | 0.50以上0.75未満    | 106,558                                          | 929                                                                | 75.98     | 106,331                         | 0.50   | 0.5           | 38.33     | 4.5            | 68,565               | 64.48                                      | 205    |           |
| 5                                                         | 0.75以上2.50未満    | 250,042                                          | 1,583                                                              | 78.48     | 249,851                         | 1.59   | 1.4           | 39.37     | 4.6            | 229,691              | 91.93                                      | 1,575  |           |
| 6                                                         | 2.50以上10.00未満   | 10,555                                           | —                                                                  | —         | 10,602                          | 7.44   | 0.0           | 40.83     | 3.5            | 13,871               | 130.83                                     | 321    |           |
| 7                                                         | 10.00以上100.00未満 | 449                                              | —                                                                  | —         | 449                             | 18.67  | 0.0           | 44.76     | 3.4            | 874                  | 194.63                                     | 37     |           |
| 8                                                         | 100.00（デフォルト）   | 9,596                                            | 266                                                                | 90.61     | 10,020                          | 100.00 | 0.0           | 43.23     | 1.0            | 0                    | 0.00                                       | 4,332  |           |
| 9                                                         | 小計              | 377,314                                          | 2,779                                                              | 78.80     | 377,367                         | 4.08   | 2.1           | 39.23     | 4.5            | 313,029              | 82.95                                      | 6,472  | 582       |

(単位：百万円、%、千件、年)

| CR6                                       |                 | 2019年9月末                 |                                        |        |                     |        |       |       |        |              |                             |       |       |
|-------------------------------------------|-----------------|--------------------------|----------------------------------------|--------|---------------------|--------|-------|-------|--------|--------------|-----------------------------|-------|-------|
|                                           |                 | イ                        | ロ                                      | ハ      | ニ                   | ホ      | ヘ     | ト     | チ      | リ            | ヌ                           | ル     | ヲ     |
| 項番                                        | PD区分            | オン・バランスシート・グロスエクスポージャーの額 | CCF・信用リスク削減手法適用前のオフ・バランスシート・エクスポージャーの額 | 平均CCF  | CCF・信用リスク削減手法適用後EAD | 平均PD   | 債務者の数 | 平均LGD | 平均残存期間 | 信用リスク・アセットの額 | リスク・ウェイトの加重平均値(RWA density) | EL    | 適格引当金 |
| 特定貸付債権（先進的内部格付手法適用分）                      |                 |                          |                                        |        |                     |        |       |       |        |              |                             |       |       |
| 1                                         | 0.00以上0.15未満    | 981,697                  | 106,790                                | 75.00  | 1,061,789           | 0.08   | 0.2   | 22.03 | 4.0    | 194,088      | 18.27                       | 196   |       |
| 2                                         | 0.15以上0.25未満    | 53,336                   | 5,850                                  | 75.00  | 57,723              | 0.20   | 0.0   | 18.07 | 3.7    | 13,012       | 22.54                       | 21    |       |
| 3                                         | 0.25以上0.50未満    | 467,747                  | 129,937                                | 74.80  | 564,947             | 0.29   | 0.1   | 24.07 | 4.6    | 230,559      | 40.81                       | 404   |       |
| 4                                         | 0.50以上0.75未満    | 302,901                  | 57,427                                 | 75.47  | 346,242             | 0.56   | 0.0   | 19.71 | 4.5    | 148,590      | 42.91                       | 392   |       |
| 5                                         | 0.75以上2.50未満    | 171,823                  | 53,316                                 | 75.00  | 211,811             | 1.34   | 0.0   | 24.77 | 4.1    | 143,120      | 67.56                       | 706   |       |
| 6                                         | 2.50以上10.00未満   | 24,111                   | 34,757                                 | 74.95  | 50,163              | 3.81   | 0.0   | 27.73 | 4.8    | 50,939       | 101.54                      | 513   |       |
| 7                                         | 10.00以上100.00未満 | 8,623                    | 2,411                                  | 75.00  | 10,432              | 21.01  | 0.0   | 25.81 | 3.6    | 14,403       | 138.06                      | 541   |       |
| 8                                         | 100.00（デフォルト）   | 9,274                    | 1,467                                  | 64.93  | 10,227              | 100.00 | 0.0   | 22.46 | 1.0    | 0            | 0.00                        | 2,297 |       |
| 9                                         | 小計              | 2,019,516                | 391,958                                | 74.96  | 2,313,338           | 0.94   | 0.5   | 22.47 | 4.2    | 794,714      | 34.35                       | 5,074 | 7,492 |
| 特定貸付債権（基礎的内部格付手法適用分）                      |                 |                          |                                        |        |                     |        |       |       |        |              |                             |       |       |
| 1                                         | 0.00以上0.15未満    | 1,467                    | —                                      | —      | 1,467               | 0.10   | 0.2   | 45.00 | 4.3    | 633          | 43.17                       | 0     |       |
| 2                                         | 0.15以上0.25未満    | 30                       | —                                      | —      | 30                  | 0.20   | 0.0   | 45.00 | 1.0    | 9            | 30.51                       | 0     |       |
| 3                                         | 0.25以上0.50未満    | 1,525                    | —                                      | —      | 1,525               | 0.30   | 0.1   | 45.00 | 4.9    | 1,219        | 79.97                       | 2     |       |
| 4                                         | 0.50以上0.75未満    | 180                      | —                                      | —      | 180                 | 0.58   | 0.0   | 45.00 | 2.8    | 143          | 79.57                       | 0     |       |
| 5                                         | 0.75以上2.50未満    | 449                      | —                                      | —      | 449                 | 1.10   | 0.0   | 45.00 | 4.8    | 562          | 125.15                      | 2     |       |
| 6                                         | 2.50以上10.00未満   | 41                       | —                                      | —      | 41                  | 3.17   | 0.0   | 45.00 | 4.9    | 66           | 161.28                      | 0     |       |
| 7                                         | 10.00以上100.00未満 | 55                       | —                                      | —      | 55                  | 25.60  | 0.0   | 45.00 | 5.0    | 141          | 255.70                      | 6     |       |
| 8                                         | 100.00（デフォルト）   | —                        | —                                      | —      | —                   | —      | —     | —     | —      | —            | —                           | —     |       |
| 9                                         | 小計              | 3,751                    | —                                      | —      | 3,751               | 0.73   | 0.4   | 45.00 | 4.5    | 2,777        | 74.05                       | 12    | —     |
| 株式等エクスポージャー（PD/LGD方式が適用されるエクスポージャーに限る）    |                 |                          |                                        |        |                     |        |       |       |        |              |                             |       |       |
| 1                                         | 0.00以上0.15未満    | 1,267,438                | 29                                     | 100.00 | 468,397             | 0.07   | 0.3   | 90.00 | 5.0    | 565,727      | 120.77                      | —     |       |
| 2                                         | 0.15以上0.25未満    | 111,564                  | —                                      | —      | 37,871              | 0.20   | 0.1   | 90.00 | 5.0    | 58,079       | 153.35                      | —     |       |
| 3                                         | 0.25以上0.50未満    | 63,280                   | —                                      | —      | 22,304              | 0.30   | 0.2   | 90.00 | 5.0    | 39,903       | 178.89                      | —     |       |
| 4                                         | 0.50以上0.75未満    | 41,775                   | —                                      | —      | 18,322              | 0.50   | 0.2   | 90.00 | 5.0    | 38,266       | 208.85                      | —     |       |
| 5                                         | 0.75以上2.50未満    | 21,041                   | —                                      | —      | 16,394              | 1.29   | 0.2   | 90.00 | 5.0    | 45,943       | 280.23                      | —     |       |
| 6                                         | 2.50以上10.00未満   | 3,276                    | —                                      | —      | 1,791               | 6.65   | 0.0   | 90.00 | 5.0    | 7,705        | 430.24                      | —     |       |
| 7                                         | 10.00以上100.00未満 | 144                      | —                                      | —      | 40                  | 18.67  | 0.0   | 90.00 | 5.0    | 297          | 731.60                      | —     |       |
| 8                                         | 100.00（デフォルト）   | 93                       | —                                      | —      | 50                  | 100.00 | 0.0   | 90.00 | 5.0    | 563          | 1,125.00                    | —     |       |
| 9                                         | 小計              | 1,508,615                | 29                                     | 100.00 | 565,173             | 0.17   | 1.3   | 90.00 | 5.0    | 756,486      | 133.85                      | —     |       |
| 購入債権（事業法人等向け）ーデフォルト・リスク相当部分（先進的内部格付手法適用分） |                 |                          |                                        |        |                     |        |       |       |        |              |                             |       |       |
| 1                                         | 0.00以上0.15未満    | 8,183                    | 7,015                                  | 75.00  | 13,444              | 0.10   | 0.0   | 37.41 | 2.9    | 4,136        | 30.76                       | 5     |       |
| 2                                         | 0.15以上0.25未満    | 21,639                   | —                                      | —      | 21,639              | 0.20   | 0.0   | 32.53 | 2.5    | 7,099        | 32.80                       | 14    |       |
| 3                                         | 0.25以上0.50未満    | 1,600                    | —                                      | —      | 1,600               | 0.30   | 0.0   | 32.53 | 4.1    | 835          | 52.20                       | 1     |       |
| 4                                         | 0.50以上0.75未満    | 1,045                    | 570                                    | 75.00  | 1,473               | 0.50   | 0.0   | 32.53 | 1.1    | 747          | 50.73                       | 2     |       |
| 5                                         | 0.75以上2.50未満    | 27,401                   | —                                      | —      | 27,401              | 1.60   | 0.0   | 32.47 | 3.9    | 24,709       | 90.17                       | 142   |       |
| 6                                         | 2.50以上10.00未満   | 2,309                    | —                                      | —      | 2,309               | 7.65   | 0.0   | 32.53 | 3.3    | 3,089        | 133.75                      | 57    |       |
| 7                                         | 10.00以上100.00未満 | —                        | —                                      | —      | —                   | —      | —     | —     | —      | —            | —                           | —     |       |
| 8                                         | 100.00（デフォルト）   | —                        | —                                      | —      | —                   | —      | —     | —     | —      | —            | —                           | —     |       |
| 9                                         | 小計              | 62,179                   | 7,585                                  | 75.00  | 67,868              | 1.01   | 0.0   | 33.47 | 3.2    | 40,617       | 59.84                       | 224   | 9     |

三井住友トラスト・ホールディングス  
決算データ三井住友信託銀行  
決算データ

三井住友トラスト・ホールディングス・パーゼル川関連データ

三井住友信託銀行  
パーゼル川関連データ

開示項目一覧

(単位：百万円、%、千件、年)

| CR6                                                               |                 | 2019年9月末                                              |                                                                         |                |                                  |           |                    |                |                     |                           |                                                 |         |                |
|-------------------------------------------------------------------|-----------------|-------------------------------------------------------|-------------------------------------------------------------------------|----------------|----------------------------------|-----------|--------------------|----------------|---------------------|---------------------------|-------------------------------------------------|---------|----------------|
| 項番                                                                | PD区分            | イ<br>オン・<br>バランス<br>シート・<br>グロス<br>エクスポ<br>ージャー<br>の額 | ロ<br>CCF・信用<br>リスク削減<br>手法適用前<br>のオフ・バ<br>ランスシ<br>ート・エクス<br>ポージャー<br>の額 | ハ<br>平均<br>CCF | ニ<br>CCF・信用<br>リスク削減<br>手法適用後EAD | ホ<br>平均PD | ヘ<br>債務<br>者の<br>数 | ト<br>平均<br>LGD | チ<br>平均<br>残存<br>期間 | リ<br>信用リスク<br>・アセット<br>の額 | ヌ<br>リスク・<br>ウェイトの<br>加重平均値<br>(RWA<br>density) | ル<br>EL | ヲ<br>適格<br>引当金 |
| 購入債権（事業法人等向け）ー希薄化リスク相当部分及びローン・パーティシペーション原債権者リスク相当部分（先進的内部格付手法適用分） |                 |                                                       |                                                                         |                |                                  |           |                    |                |                     |                           |                                                 |         |                |
| 1                                                                 | 0.00以上0.15未満    | 0                                                     | 7,015                                                                   | 75.00          | 5,261                            | 0.12      | 0.0                | 45.00          | 2.7                 | 1,903                     | 36.16                                           | 3       |                |
| 2                                                                 | 0.15以上0.25未満    | 1,710                                                 | 570                                                                     | 75.00          | 2,137                            | 0.22      | 0.0                | 100.00         | 1.0                 | 1,549                     | 72.47                                           | —       |                |
| 3                                                                 | 0.25以上0.50未満    | —                                                     | —                                                                       | —              | —                                | —         | —                  | —              | —                   | —                         | —                                               | —       |                |
| 4                                                                 | 0.50以上0.75未満    | —                                                     | —                                                                       | —              | —                                | —         | —                  | —              | —                   | —                         | —                                               | —       |                |
| 5                                                                 | 0.75以上2.50未満    | —                                                     | —                                                                       | —              | —                                | —         | —                  | —              | —                   | —                         | —                                               | —       |                |
| 6                                                                 | 2.50以上10.00未満   | —                                                     | —                                                                       | —              | —                                | —         | —                  | —              | —                   | —                         | —                                               | —       |                |
| 7                                                                 | 10.00以上100.00未満 | —                                                     | —                                                                       | —              | —                                | —         | —                  | —              | —                   | —                         | —                                               | —       |                |
| 8                                                                 | 100.00（デフォルト）   | —                                                     | —                                                                       | —              | —                                | —         | —                  | —              | —                   | —                         | —                                               | —       |                |
| 9                                                                 | 小計              | 1,710                                                 | 7,585                                                                   | 75.00          | 7,399                            | 0.15      | 0.0                | 60.88          | 2.2                 | 3,452                     | 46.65                                           | 3       | —              |
| 購入債権（事業法人等向け）ーデフォルト・リスク相当部分（基礎的内部格付手法適用分）                         |                 |                                                       |                                                                         |                |                                  |           |                    |                |                     |                           |                                                 |         |                |
| 1                                                                 | 0.00以上0.15未満    | 293,982                                               | —                                                                       | —              | 293,982                          | 0.07      | 0.3                | 45.00          | 1.2                 | 49,091                    | 16.69                                           | 94      |                |
| 2                                                                 | 0.15以上0.25未満    | 85,996                                                | —                                                                       | —              | 85,996                           | 0.20      | 0.2                | 45.00          | 1.0                 | 26,308                    | 30.59                                           | 79      |                |
| 3                                                                 | 0.25以上0.50未満    | 151,720                                               | —                                                                       | —              | 151,720                          | 0.28      | 0.3                | 45.00          | 1.0                 | 58,074                    | 38.27                                           | 192     |                |
| 4                                                                 | 0.50以上0.75未満    | 52,152                                                | —                                                                       | —              | 52,152                           | 0.50      | 1.2                | 45.00          | 1.0                 | 27,440                    | 52.61                                           | 118     |                |
| 5                                                                 | 0.75以上2.50未満    | 45,638                                                | —                                                                       | —              | 45,638                           | 1.52      | 3.9                | 45.00          | 1.4                 | 39,762                    | 87.12                                           | 312     |                |
| 6                                                                 | 2.50以上10.00未満   | 1,512                                                 | —                                                                       | —              | 1,512                            | 4.05      | 0.3                | 45.00          | 1.6                 | 1,962                     | 129.73                                          | 27      |                |
| 7                                                                 | 10.00以上100.00未満 | 4,785                                                 | —                                                                       | —              | 4,785                            | 34.67     | 0.0                | 45.00          | 4.9                 | 12,706                    | 265.54                                          | 746     |                |
| 8                                                                 | 100.00（デフォルト）   | 1                                                     | —                                                                       | —              | 1                                | 100.00    | 0.0                | 45.00          | 1.0                 | 0                         | 0.00                                            | 0       |                |
| 9                                                                 | 小計              | 635,790                                               | —                                                                       | —              | 635,790                          | 0.54      | 6.4                | 45.00          | 1.1                 | 215,346                   | 33.87                                           | 1,573   | 721            |
| 購入債権（事業法人等向け）ー希薄化リスク相当部分及びローン・パーティシペーション原債権者リスク相当部分（基礎的内部格付手法適用分） |                 |                                                       |                                                                         |                |                                  |           |                    |                |                     |                           |                                                 |         |                |
| 1                                                                 | 0.00以上0.15未満    | 450,209                                               | —                                                                       | —              | 450,209                          | 0.06      | 0.4                | 92.78          | 1.1                 | 123,220                   | 27.36                                           | 16      |                |
| 2                                                                 | 0.15以上0.25未満    | 10,540                                                | —                                                                       | —              | 10,540                           | 0.22      | 0.0                | 98.94          | 1.0                 | 7,440                     | 70.59                                           | 0       |                |
| 3                                                                 | 0.25以上0.50未満    | 27,937                                                | —                                                                       | —              | 27,937                           | 0.33      | 0.1                | 63.75          | 1.4                 | 18,481                    | 66.15                                           | 22      |                |
| 4                                                                 | 0.50以上0.75未満    | 1,102                                                 | —                                                                       | —              | 1,102                            | 0.50      | 0.0                | 45.00          | 2.6                 | 794                       | 72.07                                           | 2       |                |
| 5                                                                 | 0.75以上2.50未満    | 8,170                                                 | —                                                                       | —              | 8,170                            | 0.94      | 0.3                | 93.44          | 1.3                 | 12,379                    | 151.50                                          | 7       |                |
| 6                                                                 | 2.50以上10.00未満   | —                                                     | —                                                                       | —              | —                                | —         | —                  | —              | —                   | —                         | —                                               | —       |                |
| 7                                                                 | 10.00以上100.00未満 | —                                                     | —                                                                       | —              | —                                | —         | —                  | —              | —                   | —                         | —                                               | —       |                |
| 8                                                                 | 100.00（デフォルト）   | —                                                     | —                                                                       | —              | —                                | —         | —                  | —              | —                   | —                         | —                                               | —       |                |
| 9                                                                 | 小計              | 497,960                                               | —                                                                       | —              | 497,960                          | 0.09      | 0.9                | 91.19          | 1.1                 | 162,317                   | 32.59                                           | 48      | —              |
| 購入債権（リテール向け）ーデフォルト・リスク相当部分                                        |                 |                                                       |                                                                         |                |                                  |           |                    |                |                     |                           |                                                 |         |                |
| 1                                                                 | 0.00以上0.15未満    | —                                                     | —                                                                       | —              | —                                | —         | —                  | —              | —                   | —                         | —                                               | —       |                |
| 2                                                                 | 0.15以上0.25未満    | —                                                     | —                                                                       | —              | —                                | —         | —                  | —              | —                   | —                         | —                                               | —       |                |
| 3                                                                 | 0.25以上0.50未満    | 65,787                                                | —                                                                       | —              | 65,787                           | 0.31      | 35.5               | 74.64          | —                   | 26,683                    | 40.56                                           | 153     |                |
| 4                                                                 | 0.50以上0.75未満    | —                                                     | —                                                                       | —              | —                                | —         | —                  | —              | —                   | —                         | —                                               | —       |                |
| 5                                                                 | 0.75以上2.50未満    | —                                                     | —                                                                       | —              | —                                | —         | —                  | —              | —                   | —                         | —                                               | —       |                |
| 6                                                                 | 2.50以上10.00未満   | —                                                     | —                                                                       | —              | —                                | —         | —                  | —              | —                   | —                         | —                                               | —       |                |
| 7                                                                 | 10.00以上100.00未満 | —                                                     | —                                                                       | —              | —                                | —         | —                  | —              | —                   | —                         | —                                               | —       |                |
| 8                                                                 | 100.00（デフォルト）   | —                                                     | —                                                                       | —              | —                                | —         | —                  | —              | —                   | —                         | —                                               | —       |                |
| 9                                                                 | 小計              | 65,787                                                | —                                                                       | —              | 65,787                           | 0.31      | 35.5               | 74.64          | —                   | 26,683                    | 40.56                                           | 153     | 304            |

(単位：百万円、%、千件、年)

| CR6                     |                 | 2019年9月末                                         |                                                                        |           |                                 |        |               |           |                |                      |                                            |         |           |
|-------------------------|-----------------|--------------------------------------------------|------------------------------------------------------------------------|-----------|---------------------------------|--------|---------------|-----------|----------------|----------------------|--------------------------------------------|---------|-----------|
|                         |                 | イ                                                | ロ                                                                      | ハ         | ニ                               | ホ      | ヘ             | ト         | チ              | リ                    | ヌ                                          | ル       | ヲ         |
| 項番                      | PD区分            | オン・<br>バランス<br>シート・<br>グロス<br>エクスポ<br>ージャー<br>の額 | CCF・信用<br>リスク削減<br>手法適用前<br>のオフ・バ<br>ランスシ<br>ート・エク<br>スポー<br>ジャー<br>の額 | 平均<br>CCF | CCF・<br>信用リスク<br>削減手法<br>適用後EAD | 平均PD   | 債務<br>者の<br>数 | 平均<br>LGD | 平均<br>残存<br>期間 | 信用リスク<br>・アセット<br>の額 | リスク・<br>ウェイトの<br>加重平均値<br>(RWA<br>density) | EL      | 適格<br>引当金 |
| 適格リボルビング型リテール向けエクスポージャー |                 |                                                  |                                                                        |           |                                 |        |               |           |                |                      |                                            |         |           |
| 1                       | 0.00以上0.15未満    | 0                                                | 42,268                                                                 | 28.44     | 12,023                          | 0.11   | 44.4          | 64.24     | —              | 520                  | 4.33                                       | 8       |           |
| 2                       | 0.15以上0.25未満    | 44,969                                           | 835,819                                                                | 11.53     | 141,381                         | 0.24   | 200.3         | 58.77     | —              | 10,436               | 7.38                                       | 203     |           |
| 3                       | 0.25以上0.50未満    | 20,322                                           | 708,916                                                                | 8.14      | 78,048                          | 0.37   | 149.0         | 73.17     | —              | 10,017               | 12.83                                      | 211     |           |
| 4                       | 0.50以上0.75未満    | 35,638                                           | 275,621                                                                | 11.53     | 67,431                          | 0.59   | 85.2          | 58.77     | —              | 10,122               | 15.01                                      | 235     |           |
| 5                       | 0.75以上2.50未満    | 15,683                                           | 187,913                                                                | 11.58     | 37,443                          | 0.94   | 88.7          | 62.91     | —              | 8,571                | 22.89                                      | 221     |           |
| 6                       | 2.50以上10.00未満   | 45,213                                           | 132,761                                                                | 13.24     | 62,795                          | 4.92   | 93.5          | 59.65     | —              | 42,659               | 67.93                                      | 1,838   |           |
| 7                       | 10.00以上100.00未満 | 479                                              | 976                                                                    | 14.20     | 617                             | 49.55  | 0.7           | 62.17     | —              | 963                  | 155.99                                     | 190     |           |
| 8                       | 100.00（デフォルト）   | 63                                               | 3,698                                                                  | 7.81      | 17,074                          | 100.00 | 21.0          | 60.41     | —              | 5,109                | 29.92                                      | 9,906   |           |
| 9                       | 小計              | 162,370                                          | 2,187,975                                                              | 10.86     | 416,817                         | 5.24   | 683.2         | 62.20     | —              | 88,401               | 21.20                                      | 12,815  | 18,759    |
| 居住用不動産向けエクスポージャー        |                 |                                                  |                                                                        |           |                                 |        |               |           |                |                      |                                            |         |           |
| 1                       | 0.00以上0.15未満    | 3,214,116                                        | 16,393                                                                 | 100.00    | 3,230,509                       | 0.10   | 111.9         | 19.82     | —              | 160,983              | 4.98                                       | 694     |           |
| 2                       | 0.15以上0.25未満    | 2,979,124                                        | 90                                                                     | 100.00    | 2,979,215                       | 0.18   | 141.9         | 18.49     | —              | 207,402              | 6.96                                       | 1,012   |           |
| 3                       | 0.25以上0.50未満    | 2,541,242                                        | 2,485                                                                  | 100.00    | 2,543,737                       | 0.35   | 127.8         | 18.11     | —              | 277,206              | 10.89                                      | 1,611   |           |
| 4                       | 0.50以上0.75未満    | 708,831                                          | 73                                                                     | 100.00    | 708,905                         | 0.51   | 47.2          | 19.88     | —              | 111,933              | 15.78                                      | 724     |           |
| 5                       | 0.75以上2.50未満    | 131,858                                          | 19                                                                     | 100.00    | 131,877                         | 0.92   | 13.5          | 22.37     | —              | 34,836               | 26.41                                      | 270     |           |
| 6                       | 2.50以上10.00未満   | —                                                | —                                                                      | —         | —                               | —      | —             | —         | —              | —                    | —                                          | —       |           |
| 7                       | 10.00以上100.00未満 | 93,795                                           | 21                                                                     | 100.00    | 93,816                          | 20.59  | 5.0           | 19.36     | —              | 102,114              | 108.84                                     | 3,807   |           |
| 8                       | 100.00（デフォルト）   | 30,482                                           | 17                                                                     | 100.00    | 31,800                          | 100.00 | 1.8           | 21.10     | —              | 8,343                | 26.23                                      | 6,043   |           |
| 9                       | 小計              | 9,699,451                                        | 19,100                                                                 | 100.00    | 9,719,862                       | 0.76   | 449.5         | 19.00     | —              | 902,822              | 9.28                                       | 14,164  | 23,757    |
| その他リテール向けエクスポージャー       |                 |                                                  |                                                                        |           |                                 |        |               |           |                |                      |                                            |         |           |
| 1                       | 0.00以上0.15未満    | 0                                                | 24,660                                                                 | 22.87     | 5,642                           | 0.11   | 22.4          | 19.31     | —              | 298                  | 5.29                                       | 1       |           |
| 2                       | 0.15以上0.25未満    | —                                                | —                                                                      | —         | —                               | —      | —             | —         | —              | —                    | —                                          | —       |           |
| 3                       | 0.25以上0.50未満    | 298,799                                          | —                                                                      | —         | 298,799                         | 0.31   | 120.0         | 54.76     | —              | 88,573               | 29.64                                      | 518     |           |
| 4                       | 0.50以上0.75未満    | 362,363                                          | 495                                                                    | 100.00    | 363,057                         | 0.58   | 100.0         | 39.62     | —              | 113,511              | 31.26                                      | 855     |           |
| 5                       | 0.75以上2.50未満    | 165,384                                          | 147,638                                                                | 28.66     | 207,714                         | 1.14   | 280.8         | 64.27     | —              | 141,997              | 68.36                                      | 1,564   |           |
| 6                       | 2.50以上10.00未満   | 63,916                                           | 25,804                                                                 | 55.46     | 78,230                          | 3.82   | 64.8          | 44.93     | —              | 49,943               | 63.84                                      | 1,317   |           |
| 7                       | 10.00以上100.00未満 | 4,182                                            | 925                                                                    | 87.67     | 5,142                           | 39.81  | 1.1           | 36.89     | —              | 4,323                | 84.07                                      | 895     |           |
| 8                       | 100.00（デフォルト）   | 8,899                                            | 1,481                                                                  | 32.53     | 22,353                          | 100.00 | 13.6          | 49.48     | —              | 6,115                | 27.35                                      | 10,571  |           |
| 9                       | 小計              | 903,546                                          | 201,005                                                                | 31.87     | 980,940                         | 3.34   | 603.0         | 49.97     | —              | 404,762              | 41.26                                      | 15,725  | 16,487    |
| リース取引（基礎的内部格付手法適用分）     |                 |                                                  |                                                                        |           |                                 |        |               |           |                |                      |                                            |         |           |
| 1                       | 0.00以上0.15未満    | 190,149                                          | —                                                                      | —         | 190,149                         | 0.07   | 0.4           | 45.00     | 2.6            | 47,784               | 25.13                                      | 67      |           |
| 2                       | 0.15以上0.25未満    | 136,773                                          | —                                                                      | —         | 136,773                         | 0.20   | 0.1           | 45.00     | 4.2            | 82,629               | 60.41                                      | 126     |           |
| 3                       | 0.25以上0.50未満    | 22,919                                           | —                                                                      | —         | 22,919                          | 0.30   | 0.1           | 45.00     | 2.1            | 11,891               | 51.88                                      | 31      |           |
| 4                       | 0.50以上0.75未満    | 41,966                                           | —                                                                      | —         | 41,966                          | 0.50   | 0.2           | 45.00     | 2.9            | 31,319               | 74.62                                      | 95      |           |
| 5                       | 0.75以上2.50未満    | 37,530                                           | —                                                                      | —         | 37,530                          | 1.64   | 0.3           | 45.00     | 3.0            | 39,826               | 106.11                                     | 278     |           |
| 6                       | 2.50以上10.00未満   | 2,426                                            | —                                                                      | —         | 2,426                           | 6.26   | 0.0           | 45.00     | 3.2            | 3,815                | 157.21                                     | 68      |           |
| 7                       | 10.00以上100.00未満 | 465                                              | —                                                                      | —         | 465                             | 18.67  | 0.0           | 45.00     | 2.9            | 973                  | 209.10                                     | 39      |           |
| 8                       | 100.00（デフォルト）   | —                                                | —                                                                      | —         | 173                             | 100.00 | 0.0           | 45.00     | 1.0            | 0                    | 0.00                                       | 77      |           |
| 9                       | 小計              | 432,232                                          | —                                                                      | —         | 432,405                         | 0.40   | 1.3           | 45.00     | 3.1            | 218,239              | 50.47                                      | 784     | 3,480     |
| 合計（全てのポートフォリオ）          |                 | 49,353,056                                       | 6,726,502                                                              | 54.03     | 52,092,905                      | 0.61   | 1,796.6       | 36.02     | 2.1            | 10,458,890           | 20.07                                      | 105,608 | 126,118   |

(注) 1. ヘ欄「債務者の数」：「適格リボルビング型リテール向けエクスポージャー」、「居住用不動産向けエクスポージャー」及び「その他リテール向けエクスポージャー」については、一部債務者数の把握が困難であることから、債権数で集計しております。

2. 購入債権（リテール向け）の希薄化リスク相当部分及びローン・パーティシパシオン原債権者リスク相当部分は該当ありません。

三井住友トラスト・ホールディングス  
決算データ三井住友信託銀行  
決算データ

三井住友トラスト・ホールディングス・パーゼル川関連データ

三井住友信託銀行  
パーゼル川関連データ

開示項目一覧

# CR7：内部格付手法－信用リスク削減手法として用いられるクレジット・デリバティブが信用リスク・アセットの額に与える影響

(単位：百万円)

| CR7 |                                 | 2020年9月末                             |                     |
|-----|---------------------------------|--------------------------------------|---------------------|
| 項番  | ポートフォリオ                         | イ                                    | ロ                   |
|     |                                 | クレジット・デリバティブ<br>勘案前の<br>信用リスク・アセットの額 | 実際の<br>信用リスク・アセットの額 |
| 1   | ソブリン向けエクスポージャー－FIRB             | 77,514                               | 77,514              |
| 2   | ソブリン向けエクスポージャー－AIRB             | 13,970                               | 13,970              |
| 3   | 金融機関等向けエクスポージャー－FIRB            | 81,826                               | 81,826              |
| 4   | 金融機関等向けエクスポージャー－AIRB            | 146,304                              | 146,304             |
| 5   | 事業法人向けエクスポージャー（特定貸付債権を除く。）－FIRB | 1,960,500                            | 1,960,500           |
| 6   | 事業法人向けエクスポージャー（特定貸付債権を除く。）－AIRB | 4,757,927                            | 4,757,927           |
| 7   | 特定貸付債権－FIRB                     | 362,276                              | 362,276             |
| 8   | 特定貸付債権－AIRB                     | 1,251,486                            | 1,251,486           |
| 9   | リテール－適格リボルビング型リテール向けエクスポージャー    | 94,867                               | 94,867              |
| 10  | リテール－居住用不動産向けエクスポージャー           | 797,652                              | 797,652             |
| 11  | リテール－その他リテール向けエクスポージャー          | 380,425                              | 380,425             |
| 12  | 株式－FIRB                         | 1,012,330                            | 1,012,330           |
| 13  | 株式－AIRB                         | －                                    | －                   |
| 14  | 購入債権－FIRB                       | 287,866                              | 287,866             |
| 15  | 購入債権－AIRB                       | 43,795                               | 43,795              |
| 16  | 合計                              | 11,268,745                           | 11,268,745          |

(注) 1. 当グループは信用リスク削減手法としてクレジット・デリバティブを利用しておりません。

(単位：百万円)

| CR7 |                                 | 2019年9月末                             |                     |
|-----|---------------------------------|--------------------------------------|---------------------|
| 項番  | ポートフォリオ                         | イ                                    | ロ                   |
|     |                                 | クレジット・デリバティブ<br>勘案前の<br>信用リスク・アセットの額 | 実際の<br>信用リスク・アセットの額 |
| 1   | ソブリン向けエクスポージャー－FIRB             | 96,111                               | 96,111              |
| 2   | ソブリン向けエクスポージャー－AIRB             | 15,319                               | 15,319              |
| 3   | 金融機関等向けエクスポージャー－FIRB            | 173,756                              | 173,756             |
| 4   | 金融機関等向けエクスポージャー－AIRB            | 119,616                              | 119,616             |
| 5   | 事業法人向けエクスポージャー（特定貸付債権を除く。）－FIRB | 1,958,646                            | 1,958,646           |
| 6   | 事業法人向けエクスポージャー（特定貸付債権を除く。）－AIRB | 4,478,819                            | 4,478,819           |
| 7   | 特定貸付債権－FIRB                     | 930,228                              | 930,228             |
| 8   | 特定貸付債権－AIRB                     | 794,714                              | 794,714             |
| 9   | リテール－適格リボルビング型リテール向けエクスポージャー    | 88,401                               | 88,401              |
| 10  | リテール－居住用不動産向けエクスポージャー           | 902,822                              | 902,822             |
| 11  | リテール－その他リテール向けエクスポージャー          | 404,762                              | 404,762             |
| 12  | 株式－FIRB                         | 996,539                              | 996,539             |
| 13  | 株式－AIRB                         | －                                    | －                   |
| 14  | 購入債権－FIRB                       | 404,347                              | 404,347             |
| 15  | 購入債権－AIRB                       | 44,069                               | 44,069              |
| 16  | 合計                              | 11,408,154                           | 11,408,154          |

(注) 1. 当グループは信用リスク削減手法としてクレジット・デリバティブを利用しておりません。

# CR10：内部格付手法－特定貸付債権（スロットティング・クライテリア方式）と株式等エクスポージャー（マーケット・ベース方式等）

(単位：百万円、%)

| CR10                                                                                                       |        | 2020年9月末             |                      |              |                 |         |       |                         |                      |                      |      |
|------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------|----------------------|----------------------|--------------|-----------------|---------|-------|-------------------------|----------------------|----------------------|------|
| イ                                                                                                          | ロ      | ハ                    | ニ                    | ホ            | ヘ               | ト       | チ     | リ                       | ヌ                    | ル                    | ヲ    |
| 特定貸付債権（スロットティング・クライテリア方式）                                                                                  |        |                      |                      |              |                 |         |       |                         |                      |                      |      |
| ボラティリティの高い事業用不動産向け貸付け（HVCRE）以外                                                                             |        |                      |                      |              |                 |         |       |                         |                      |                      |      |
| 規制上の区分                                                                                                     | 残存期間   | オン・<br>バランス<br>シートの額 | オフ・<br>バランス<br>シートの額 | リスク・<br>ウェイト | エクスポージャーの額（EAD） |         |       |                         |                      | 信用リスク・<br>アセット<br>の額 | 期待損失 |
|                                                                                                            |        |                      |                      |              | PF              | OF      | CF    | IPRE                    | 合計                   |                      |      |
| 優（Strong）                                                                                                  | 2.5年未満 | —                    | —                    | 50%          | —               | —       | —     | —                       | —                    | —                    | —    |
|                                                                                                            | 2.5年以上 | —                    | —                    | 70%          | —               | —       | —     | —                       | —                    | —                    | —    |
| 良（Good）                                                                                                    | 2.5年未満 | —                    | —                    | 70%          | —               | —       | —     | —                       | —                    | —                    | —    |
|                                                                                                            | 2.5年以上 | —                    | —                    | 90%          | —               | —       | —     | —                       | —                    | —                    | —    |
| 可（Satisfactory）                                                                                            |        | —                    | —                    | 115%         | —               | —       | —     | —                       | —                    | —                    | —    |
| 弱い（Weak）                                                                                                   |        | —                    | —                    | 250%         | —               | —       | —     | —                       | —                    | —                    | —    |
| デフォルト（Default）                                                                                             |        | —                    | —                    | —            | —               | —       | —     | —                       | —                    | —                    | —    |
| 合計                                                                                                         |        | —                    | —                    | —            | —               | —       | —     | —                       | —                    | —                    | —    |
| ボラティリティの高い事業用不動産向け貸付け（HVCRE）                                                                               |        |                      |                      |              |                 |         |       |                         |                      |                      |      |
| 規制上の区分                                                                                                     | 残存期間   | オン・<br>バランス<br>シートの額 | オフ・<br>バランス<br>シートの額 | リスク・<br>ウェイト |                 |         |       | エクスポー<br>ジャーの額<br>（EAD） | 信用リスク<br>・アセット<br>の額 | 期待損失                 |      |
| 優（Strong）                                                                                                  | 2.5年未満 | 2,321                | 2,968                | 70%          |                 |         |       | 4,548                   | 3,183                | 18                   |      |
|                                                                                                            | 2.5年以上 | 1,029                | 1,257                | 95%          |                 |         |       | 1,971                   | 1,873                | 7                    |      |
| 良（Good）                                                                                                    | 2.5年未満 | 44,226               | 3,906                | 95%          |                 |         |       | 47,156                  | 44,798               | 188                  |      |
|                                                                                                            | 2.5年以上 | 30,092               | 52,340               | 120%         |                 |         |       | 69,348                  | 83,217               | 277                  |      |
| 可（Satisfactory）                                                                                            |        | 49,013               | 47,198               | 140%         |                 |         |       | 84,412                  | 118,177              | 2,363                |      |
| 弱い（Weak）                                                                                                   |        | 40,107               | 4,999                | 250%         |                 |         |       | 43,857                  | 109,643              | 3,508                |      |
| デフォルト（Default）                                                                                             |        | —                    | —                    | —            |                 |         |       | —                       | —                    | —                    |      |
| 合計                                                                                                         |        | 166,791              | 112,670              | —            | 251,294         | 360,894 | 6,364 |                         |                      |                      |      |
| 株式等エクスポージャー（マーケット・ベース方式等）                                                                                  |        |                      |                      |              |                 |         |       |                         |                      |                      |      |
| マーケット・ベース方式が適用される株式等エクスポージャー                                                                               |        |                      |                      |              |                 |         |       |                         |                      |                      |      |
| カテゴリー                                                                                                      |        | オン・<br>バランス<br>シートの額 | オフ・<br>バランス<br>シートの額 | リスク・<br>ウェイト |                 |         |       | エクスポー<br>ジャーの額<br>（EAD） | 信用リスク<br>・アセット<br>の額 |                      |      |
| 簡易手法－上場株式                                                                                                  |        | 11,232               | 39,047               | 300%         |                 |         |       | 50,280                  | 150,842              |                      |      |
| 簡易手法－非上場株式                                                                                                 |        | 21,515               | 4,163                | 400%         |                 |         |       | 24,638                  | 98,552               |                      |      |
| 内部モデル手法                                                                                                    |        | —                    | —                    | —            |                 |         |       | —                       | —                    |                      |      |
| 合計                                                                                                         |        | 32,748               | 43,211               | —            |                 |         |       | 74,918                  | 249,395              |                      |      |
| 100%のリスク・ウェイトが適用される株式等エクスポージャー                                                                             |        |                      |                      |              |                 |         |       |                         |                      |                      |      |
| 自己資本比率告示第百六十六条<br>第一項ただし書又は持株自己資<br>本比率告示第百四十四条第一項<br>ただし書の定めるところにより<br>100%のリスク・ウェイトが適用さ<br>れる株式等エクスポージャー |        | —                    | —                    | 100%         |                 |         |       | —                       | —                    |                      |      |

三井住友トラスト・ホールディングス  
決算データ三井住友信託銀行  
決算データ三井住友トラスト・ホールディングス  
パーゼル川関連データ三井住友信託銀行  
パーゼル川関連データ

開示項目一覧

(単位：百万円、%)

| CR10                                                                                                       |        | 2019年9月末             |                      |              |                 |         |       |                         |                      |                      |        |
|------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------|----------------------|----------------------|--------------|-----------------|---------|-------|-------------------------|----------------------|----------------------|--------|
| イ                                                                                                          | ロ      | ハ                    | ニ                    | ホ            | ヘ               | ト       | チ     | リ                       | ヌ                    | ル                    | ヲ      |
| 特定貸付債権（スロッシング・クライテリア方式）                                                                                    |        |                      |                      |              |                 |         |       |                         |                      |                      |        |
| ボラティリティの高い事業用不動産向け貸付け（HVCRE）以外                                                                             |        |                      |                      |              |                 |         |       |                         |                      |                      |        |
| 規制上の区分                                                                                                     | 残存期間   | オン・<br>バランス<br>シートの額 | オフ・<br>バランス<br>シートの額 | リスク・<br>ウェイト | エクスポージャーの額（EAD） |         |       |                         |                      | 信用リスク<br>・アセット<br>の額 | 期待損失   |
|                                                                                                            |        |                      |                      |              | PF              | OF      | CF    | IPRE                    | 合計                   |                      |        |
| 優（Strong）                                                                                                  | 2.5年未満 | 43,793               | －                    | 50%          | －               | 9,131   | －     | 34,661                  | 43,793               | 21,896               | －      |
|                                                                                                            | 2.5年以上 | 166,240              | 39,348               | 70%          | －               | 195,676 | －     | 75                      | 195,751              | 137,026              | 783    |
| 良（Good）                                                                                                    | 2.5年未満 | 51,187               | －                    | 70%          | －               | 20,493  | －     | 30,693                  | 51,187               | 35,831               | 204    |
|                                                                                                            | 2.5年以上 | 199,125              | 12,812               | 90%          | －               | 208,596 | －     | 138                     | 208,734              | 187,861              | 1,669  |
| 可（Satisfactory）                                                                                            |        | 134,089              | 2,769                | 115%         | －               | 81,972  | －     | 54,194                  | 136,166              | 156,591              | 3,812  |
| 弱い（Weak）                                                                                                   |        | 28,252               | －                    | 250%         | －               | 26,091  | －     | 2,160                   | 28,252               | 70,631               | 2,260  |
| デフォルト（Default）                                                                                             |        | 7,972                | －                    | －            | －               | 1,334   | －     | 6,638                   | 7,972                | －                    | 3,986  |
| 合計                                                                                                         |        | 630,661              | 54,930               | －            | －               | 543,296 | －     | 128,563                 | 671,859              | 609,838              | 12,716 |
| ボラティリティの高い事業用不動産向け貸付け（HVCRE）                                                                               |        |                      |                      |              |                 |         |       |                         |                      |                      |        |
| 規制上の区分                                                                                                     | 残存期間   | オン・<br>バランス<br>シートの額 | オフ・<br>バランス<br>シートの額 | リスク・<br>ウェイト |                 |         |       | エクスポ<br>ージャーの額<br>（EAD） | 信用リスク<br>・アセット<br>の額 | 期待損失                 |        |
| 優（Strong）                                                                                                  | 2.5年未満 | 5,649                | －                    | 70%          |                 |         |       | 5,649                   | 3,954                | 22                   |        |
|                                                                                                            | 2.5年以上 | 21                   | －                    | 95%          |                 |         |       | 21                      | 20                   | 0                    |        |
| 良（Good）                                                                                                    | 2.5年未満 | 8,600                | －                    | 95%          |                 |         |       | 8,600                   | 8,170                | 34                   |        |
|                                                                                                            | 2.5年以上 | 14,849               | 31,640               | 120%         |                 |         |       | 38,579                  | 46,295               | 154                  |        |
| 可（Satisfactory）                                                                                            |        | 108,831              | 65,037               | 140%         |                 |         |       | 157,609                 | 220,653              | 4,413                |        |
| 弱い（Weak）                                                                                                   |        | 7,331                | 10,767               | 250%         |                 |         |       | 15,406                  | 38,516               | 1,232                |        |
| デフォルト（Default）                                                                                             |        | －                    | －                    | －            |                 |         |       | －                       | －                    | －                    |        |
| 合計                                                                                                         |        | 145,283              | 107,445              | －            | 225,867         | 317,611 | 5,857 |                         |                      |                      |        |
| 株式等エクスポージャー（マーケット・ベース方式等）                                                                                  |        |                      |                      |              |                 |         |       |                         |                      |                      |        |
| マーケット・ベース方式が適用される株式等エクスポージャー                                                                               |        |                      |                      |              |                 |         |       |                         |                      |                      |        |
| カテゴリー                                                                                                      |        | オン・<br>バランス<br>シートの額 | オフ・<br>バランス<br>シートの額 | リスク・<br>ウェイト |                 |         |       | エクスポ<br>ージャーの額<br>（EAD） | 信用リスク<br>・アセット<br>の額 |                      |        |
| 簡易手法－上場株式                                                                                                  |        | 11,540               | 38,903               | 300%         |                 |         |       | 50,444                  | 151,332              |                      |        |
| 簡易手法－非上場株式                                                                                                 |        | 22,180               | －                    | 400%         |                 |         |       | 22,180                  | 88,720               |                      |        |
| 内部モデル手法                                                                                                    |        | －                    | －                    | －            |                 |         |       | －                       | －                    |                      |        |
| 合計                                                                                                         |        | 33,720               | 38,903               | －            |                 |         |       | 72,624                  | 240,052              |                      |        |
| 100%のリスク・ウェイトが適用される株式等エクスポージャー                                                                             |        |                      |                      |              |                 |         |       |                         |                      |                      |        |
| 自己資本比率告示第百六十六条<br>第一項ただし書又は持株自己資本<br>比率告示第百四十四条第一項<br>ただし書の定めるところにより<br>100%のリスク・ウェイトが適用さ<br>れる株式等エクスポージャー |        | －                    | －                    | 100%         |                 |         |       | －                       | －                    |                      |        |

## CCR1：手法別のカウンターパーティ信用リスク・エクスポージャー額

(単位：百万円)

| CCR1 |                    | 2020年9月末 |         |       |                                |                       |            |
|------|--------------------|----------|---------|-------|--------------------------------|-----------------------|------------|
| 項番   |                    | イ        | ロ       | ハ     | ニ                              | ホ                     | ヘ          |
|      |                    | RC       | PFE     | 実効EPE | 規制上のエクスポージャーの算定に使用される $\alpha$ | 信用リスク削減手法適用後のエクスポージャー | リスク・アセットの額 |
| 1    | SA-CCR             | —        | —       |       | 1.4                            | —                     | —          |
|      | カレント・エクスポージャー方式    | 374,264  | 520,502 |       |                                | 894,767               | 389,420    |
| 2    | 期待エクスポージャー方式       |          |         | —     | —                              | —                     | —          |
| 3    | 信用リスク削減手法における簡便手法  |          |         |       |                                | —                     | —          |
| 4    | 信用リスク削減手法における包括的手法 |          |         |       |                                | 645,578               | 105,129    |
| 5    | エクスポージャー変動推計モデル    |          |         |       |                                | —                     | —          |
| 6    | 合計                 |          |         |       |                                |                       | 494,550    |

(単位：百万円)

| CCR1 |                    | 2019年9月末 |         |       |                                |                       |            |
|------|--------------------|----------|---------|-------|--------------------------------|-----------------------|------------|
| 項番   |                    | イ        | ロ       | ハ     | ニ                              | ホ                     | ヘ          |
|      |                    | RC       | PFE     | 実効EPE | 規制上のエクスポージャーの算定に使用される $\alpha$ | 信用リスク削減手法適用後のエクスポージャー | リスク・アセットの額 |
| 1    | SA-CCR             | —        | —       |       | 1.4                            | —                     | —          |
|      | カレント・エクスポージャー方式    | 372,078  | 508,078 |       |                                | 880,156               | 334,952    |
| 2    | 期待エクスポージャー方式       |          |         | —     | —                              | —                     | —          |
| 3    | 信用リスク削減手法における簡便手法  |          |         |       |                                | —                     | —          |
| 4    | 信用リスク削減手法における包括的手法 |          |         |       |                                | 589,641               | 88,452     |
| 5    | エクスポージャー変動推計モデル    |          |         |       |                                | —                     | —          |
| 6    | 合計                 |          |         |       |                                |                       | 423,405    |

## CCR2：CVAリスクに対する資本賦課

(単位：百万円)

| CCR2 |                                     | 2020年9月末                       |                                              |
|------|-------------------------------------|--------------------------------|----------------------------------------------|
| 項番   |                                     | イ<br>信用リスク削減手法適用後の<br>エクスポージャー | ロ<br>リスク・アセットの額<br>(CVAリスク相当額を8%で<br>除して得た額) |
| 1    | 先進的リスク測定方式の対象となるポートフォリオの合計          | —                              | —                                            |
| 2    | (i) CVAバリュー・アット・リスクの額 (乗数適用後)       |                                | —                                            |
| 3    | (ii) CVAストレス・バリュー・アット・リスクの額 (乗数適用後) |                                | —                                            |
| 4    | 標準的リスク測定方式の対象となるポートフォリオの合計          | 811,987                        | 666,708                                      |
| 5    | CVAリスク相当額の対象となるポートフォリオの合計           | 811,987                        | 666,708                                      |

(単位：百万円)

| CCR2 |                                     | 2019年9月末                       |                                              |
|------|-------------------------------------|--------------------------------|----------------------------------------------|
| 項番   |                                     | イ<br>信用リスク削減手法適用後の<br>エクスポージャー | ロ<br>リスク・アセットの額<br>(CVAリスク相当額を8%で<br>除して得た額) |
| 1    | 先進的リスク測定方式の対象となるポートフォリオの合計          | —                              | —                                            |
| 2    | (i) CVAバリュー・アット・リスクの額 (乗数適用後)       |                                | —                                            |
| 3    | (ii) CVAストレス・バリュー・アット・リスクの額 (乗数適用後) |                                | —                                            |
| 4    | 標準的リスク測定方式の対象となるポートフォリオの合計          | 885,390                        | 643,868                                      |
| 5    | CVAリスク相当額の対象となるポートフォリオの合計           | 885,390                        | 643,868                                      |

## CCR3：業種別及びリスク・ウェイト別のカウンターパーティ信用リスク・エクスポージャー

(単位：百万円)

| CCR3 |                     | 2020年9月末            |     |         |     |     |      |      |     |         |
|------|---------------------|---------------------|-----|---------|-----|-----|------|------|-----|---------|
| 項番   | リスク・ウェイト<br>業種      | イ                   | ロ   | ハ       | ニ   | ホ   | ヘ    | ト    | チ   | リ       |
|      |                     | 与信相当額（信用リスク削減効果勘案後） |     |         |     |     |      |      |     |         |
|      |                     | 0%                  | 10% | 20%     | 50% | 75% | 100% | 150% | その他 | 合計      |
| 1    | 日本国政府及び日本銀行向け       | —                   | —   | —       | —   | —   | —    | —    | —   | —       |
| 2    | 外国の中央政府及び中央銀行向け     | —                   | —   | —       | —   | —   | —    | —    | —   | —       |
| 3    | 国際決済銀行等向け           | —                   | —   | —       | —   | —   | —    | —    | —   | —       |
| 4    | 我が国の地方公共団体向け        | —                   | —   | —       | —   | —   | —    | —    | —   | —       |
| 5    | 外国の中央政府等以外の公共部門向け   | —                   | —   | —       | —   | —   | —    | —    | —   | —       |
| 6    | 国際開発銀行向け            | —                   | —   | —       | —   | —   | —    | —    | —   | —       |
| 7    | 地方公共団体金融機構向け        | —                   | —   | —       | —   | —   | —    | —    | —   | —       |
| 8    | 我が国の政府関係機関向け        | —                   | —   | —       | —   | —   | —    | —    | —   | —       |
| 9    | 地方三公社向け             | —                   | —   | —       | —   | —   | —    | —    | —   | —       |
| 10   | 金融機関及び第一種金融商品取引業者向け | —                   | —   | 396,296 | —   | —   | —    | —    | —   | 396,296 |
| 11   | 法人等向け               | —                   | —   | —       | —   | —   | —    | —    | —   | —       |
| 12   | 中小企業等向け及び個人向け       | —                   | —   | —       | —   | —   | —    | —    | —   | —       |
| 13   | 上記以外                | —                   | —   | —       | —   | —   | —    | —    | —   | —       |
| 14   | 合計                  | —                   | —   | 396,296 | —   | —   | —    | —    | —   | 396,296 |

(注) 1. 本面では、標準的手法を適用しているエクスポージャーを集計しております。

(単位：百万円)

| CCR3 |                     | 2019年9月末            |     |         |     |     |      |      |     |         |
|------|---------------------|---------------------|-----|---------|-----|-----|------|------|-----|---------|
| 項番   | リスク・ウェイト<br>業種      | イ                   | ロ   | ハ       | ニ   | ホ   | ヘ    | ト    | チ   | リ       |
|      |                     | 与信相当額（信用リスク削減効果勘案後） |     |         |     |     |      |      |     |         |
|      |                     | 0%                  | 10% | 20%     | 50% | 75% | 100% | 150% | その他 | 合計      |
| 1    | 日本国政府及び日本銀行向け       | —                   | —   | —       | —   | —   | —    | —    | —   | —       |
| 2    | 外国の中央政府及び中央銀行向け     | —                   | —   | —       | —   | —   | —    | —    | —   | —       |
| 3    | 国際決済銀行等向け           | —                   | —   | —       | —   | —   | —    | —    | —   | —       |
| 4    | 我が国の地方公共団体向け        | —                   | —   | —       | —   | —   | —    | —    | —   | —       |
| 5    | 外国の中央政府等以外の公共部門向け   | —                   | —   | —       | —   | —   | —    | —    | —   | —       |
| 6    | 国際開発銀行向け            | —                   | —   | —       | —   | —   | —    | —    | —   | —       |
| 7    | 地方公共団体金融機構向け        | —                   | —   | —       | —   | —   | —    | —    | —   | —       |
| 8    | 我が国の政府関係機関向け        | —                   | —   | —       | —   | —   | —    | —    | —   | —       |
| 9    | 地方三公社向け             | —                   | —   | —       | —   | —   | —    | —    | —   | —       |
| 10   | 金融機関及び第一種金融商品取引業者向け | —                   | —   | 338,739 | —   | —   | —    | —    | —   | 338,739 |
| 11   | 法人等向け               | —                   | —   | —       | —   | —   | —    | —    | —   | —       |
| 12   | 中小企業等向け及び個人向け       | —                   | —   | —       | —   | —   | —    | —    | —   | —       |
| 13   | 上記以外                | —                   | —   | —       | —   | —   | —    | —    | —   | —       |
| 14   | 合計                  | —                   | —   | 338,739 | —   | —   | —    | —    | —   | 338,739 |

(注) 1. 本面では、標準的手法を適用しているエクスポージャーを集計しております。

## CCR4：内部格付手法－ポートフォリオ別及びPD区分別のカウンターパーティ信用リスク・エクスポージャー

(単位：百万円、%、千件、年)

| CCR4            |                 | 2020年9月末                           |           |                  |            |             |                     |                                              |
|-----------------|-----------------|------------------------------------|-----------|------------------|------------|-------------|---------------------|----------------------------------------------|
| 項番              | PD区分            | イ<br>EAD<br>(信用リスク<br>削減効果<br>勘案後) | ロ<br>平均PD | ハ<br>取引相手方の<br>数 | ニ<br>平均LGD | ホ<br>平均残存期間 | ヘ<br>信用リスク・<br>アセット | ト<br>リスク・<br>ウェイトの<br>加重平均値<br>(RWA density) |
| ソブリン向けエクスポージャー  |                 |                                    |           |                  |            |             |                     |                                              |
| 1               | 0.00以上0.15未満    | 25,369                             | 0.02      | 0.0              | 38.74      | 2.1         | 2,780               | 10.96                                        |
| 2               | 0.15以上0.25未満    | —                                  | —         | —                | —          | —           | —                   | —                                            |
| 3               | 0.25以上0.50未満    | 178                                | 0.26      | 0.0              | 45.00      | 1.0         | 85                  | 47.82                                        |
| 4               | 0.50以上0.75未満    | —                                  | —         | —                | —          | —           | —                   | —                                            |
| 5               | 0.75以上2.50未満    | —                                  | —         | —                | —          | —           | —                   | —                                            |
| 6               | 2.50以上10.00未満   | —                                  | —         | —                | —          | —           | —                   | —                                            |
| 7               | 10.00以上100.00未満 | —                                  | —         | —                | —          | —           | —                   | —                                            |
| 8               | 100.00 (デフォルト)  | —                                  | —         | —                | —          | —           | —                   | —                                            |
| 9               | 小計              | 25,548                             | 0.02      | 0.0              | 38.78      | 2.1         | 2,866               | 11.21                                        |
| 金融機関等向けエクスポージャー |                 |                                    |           |                  |            |             |                     |                                              |
| 1               | 0.00以上0.15未満    | 414,560                            | 0.05      | 0.1              | 17.75      | 2.9         | 90,526              | 21.83                                        |
| 2               | 0.15以上0.25未満    | 297                                | 0.20      | 0.0              | 45.00      | 3.0         | 136                 | 45.85                                        |
| 3               | 0.25以上0.50未満    | 34,259                             | 0.28      | 0.0              | 27.29      | 4.2         | 28,685              | 83.72                                        |
| 4               | 0.50以上0.75未満    | 337                                | 0.50      | 0.0              | 45.00      | 1.0         | 176                 | 52.44                                        |
| 5               | 0.75以上2.50未満    | 463                                | 1.03      | 0.0              | 45.00      | 1.0         | 344                 | 74.38                                        |
| 6               | 2.50以上10.00未満   | —                                  | —         | —                | —          | —           | —                   | —                                            |
| 7               | 10.00以上100.00未満 | —                                  | —         | —                | —          | —           | —                   | —                                            |
| 8               | 100.00 (デフォルト)  | —                                  | —         | —                | —          | —           | —                   | —                                            |
| 9               | 小計              | 449,917                            | 0.07      | 0.1              | 18.26      | 3.0         | 119,869             | 26.64                                        |
| 事業法人向けエクスポージャー  |                 |                                    |           |                  |            |             |                     |                                              |
| 1               | 0.00以上0.15未満    | 299,327                            | 0.05      | 0.2              | 9.31       | 1.5         | 59,571              | 19.90                                        |
| 2               | 0.15以上0.25未満    | 26,645                             | 0.20      | 0.0              | 45.00      | 4.6         | 16,713              | 62.72                                        |
| 3               | 0.25以上0.50未満    | 10,824                             | 0.30      | 0.0              | 45.00      | 3.9         | 7,880               | 72.80                                        |
| 4               | 0.50以上0.75未満    | 5,732                              | 0.50      | 0.0              | 46.40      | 4.1         | 5,146               | 89.78                                        |
| 5               | 0.75以上2.50未満    | 6,823                              | 1.49      | 0.1              | 45.00      | 3.8         | 8,704               | 127.56                                       |
| 6               | 2.50以上10.00未満   | 1,818                              | 4.05      | 0.0              | 45.00      | 4.6         | 3,006               | 165.31                                       |
| 7               | 10.00以上100.00未満 | 786                                | 34.62     | 0.0              | 45.00      | 2.4         | 2,135               | 271.51                                       |
| 8               | 100.00 (デフォルト)  | 1                                  | 100.00    | 0.0              | 45.00      | 1.0         | 0                   | 0.00                                         |
| 9               | 小計              | 351,961                            | 0.20      | 0.6              | 10.50      | 1.9         | 103,158             | 29.30                                        |
| 特定貸付債権          |                 |                                    |           |                  |            |             |                     |                                              |
| 1               | 0.00以上0.15未満    | 101,829                            | 0.08      | 0.1              | 45.00      | 4.8         | 42,948              | 42.17                                        |
| 2               | 0.15以上0.25未満    | 846                                | 0.20      | 0.0              | 45.00      | 3.6         | 468                 | 55.32                                        |
| 3               | 0.25以上0.50未満    | 41,401                             | 0.29      | 0.0              | 45.00      | 4.9         | 33,183              | 80.14                                        |
| 4               | 0.50以上0.75未満    | 8,161                              | 0.67      | 0.0              | 45.00      | 4.9         | 8,908               | 109.14                                       |
| 5               | 0.75以上2.50未満    | 48,615                             | 1.40      | 0.0              | 45.00      | 4.8         | 64,189              | 132.03                                       |
| 6               | 2.50以上10.00未満   | 23,413                             | 3.25      | 0.0              | 45.00      | 4.8         | 37,526              | 160.28                                       |
| 7               | 10.00以上100.00未満 | —                                  | —         | —                | —          | —           | —                   | —                                            |
| 8               | 100.00 (デフォルト)  | 49                                 | 100.00    | 0.0              | 45.00      | 1.0         | 0                   | 0.00                                         |
| 9               | 小計              | 224,316                            | 0.78      | 0.2              | 45.00      | 4.8         | 187,225             | 83.46                                        |
| 合計 (全てのポートフォリオ) |                 | 1,051,744                          | 0.26      | 1.0              | 16.33      | 3.0         | 413,119             | 39.27                                        |

(注) 1. 当グループは、カウンターパーティ信用リスクに係るリスク・アセットの計算には基礎的内部格付手法を適用しております。  
2. 今期より「特定貸付債権」を区分して表示しております。

三井住友トラスト・ホールディングス  
決算データ三井住友信託銀行  
決算データ三井住友トラスト・ホールディングス  
パーゼル川関連データ三井住友信託銀行  
パーゼル川関連データ

開示項目一覧



## CCR5：担保の内訳

(単位：百万円)

| CCR5 |          | 2020年9月末       |                |               |                |                 |           |
|------|----------|----------------|----------------|---------------|----------------|-----------------|-----------|
| 項番   |          | イ              | ロ              | ハ             | ニ              | ホ               | ヘ         |
|      |          | 派生商品取引で使用される担保 |                |               |                | レボ形式の取引で使用される担保 |           |
|      |          | 受入担保の公正価値      |                | 差入担保の公正価値     |                | 受入担保の公正価値       | 差入担保の公正価値 |
|      |          | 分別管理<br>されている  | 分別管理<br>されていない | 分別管理<br>されている | 分別管理<br>されていない |                 |           |
| 1    | 現金（国内通貨） | —              | 153,926        | —             | 270,897        | —               | 789,671   |
| 2    | 現金（外国通貨） | —              | 5,266          | —             | 246,026        | 1,013,945       | 928       |
| 3    | 国内ソブリン債  | —              | 749            | —             | 26,488         | 157,328         | 296,235   |
| 4    | その他ソブリン債 | —              | —              | —             | —              | 992,112         | 1,502,516 |
| 5    | 政府関係機関債  | —              | —              | —             | —              | 60,480          | 12,522    |
| 6    | 社債       | —              | —              | —             | —              | 482,272         | 408,954   |
| 7    | 株式       | —              | —              | —             | 11,041         | 536,834         | 625,230   |
| 8    | その他担保    | —              | —              | —             | —              | —               | —         |
| 9    | 合計       | —              | 159,943        | —             | 554,454        | 3,242,974       | 3,636,059 |

(単位：百万円)

| CCR5 |          | 2019年9月末       |                |               |                |                 |           |
|------|----------|----------------|----------------|---------------|----------------|-----------------|-----------|
| 項番   |          | イ              | ロ              | ハ             | ニ              | ホ               | ヘ         |
|      |          | 派生商品取引で使用される担保 |                |               |                | レボ形式の取引で使用される担保 |           |
|      |          | 受入担保の公正価値      |                | 差入担保の公正価値     |                | 受入担保の公正価値       | 差入担保の公正価値 |
|      |          | 分別管理<br>されている  | 分別管理<br>されていない | 分別管理<br>されている | 分別管理<br>されていない |                 |           |
| 1    | 現金（国内通貨） | —              | 108,412        | —             | 269,824        | 18,010          | 763,873   |
| 2    | 現金（外国通貨） | —              | 1,412          | —             | 131,450        | 1,159,270       | 33,245    |
| 3    | 国内ソブリン債  | —              | 2,753          | —             | 6,535          | 93,929          | 305,658   |
| 4    | その他ソブリン債 | —              | —              | —             | —              | 924,094         | 1,484,073 |
| 5    | 政府関係機関債  | —              | —              | —             | —              | 578,821         | 585,791   |
| 6    | 社債       | —              | —              | —             | —              | 73,369          | 3,052     |
| 7    | 株式       | —              | —              | —             | 9,657          | 677,137         | 754,514   |
| 8    | その他担保    | —              | —              | —             | —              | —               | —         |
| 9    | 合計       | —              | 112,578        | —             | 417,466        | 3,524,633       | 3,930,210 |

三井住友トラスト・ホールディングス  
決算データ三井住友信託銀行  
決算データ三井住友トラスト・ホールディングス  
パーゼル川関連データ三井住友信託銀行  
パーゼル川関連データ

開示項目一覧

## CCR6：クレジット・デリバティブ取引のエクスポージャー

(単位：百万円)

| CCR6 |                          | 2020年9月末    |             |
|------|--------------------------|-------------|-------------|
| 項番   |                          | イ           | ロ           |
|      |                          | 購入したプロテクション | 提供したプロテクション |
| 想定元本 |                          |             |             |
| 1    | シングルネーム・クレジット・デフォルト・スワップ | 63,600      | 65,600      |
| 2    | インデックス・クレジット・デフォルト・スワップ  | －           | －           |
| 3    | トータル・リターン・スワップ           | －           | －           |
| 4    | クレジットオプション               | －           | －           |
| 5    | その他のクレジット・デリバティブ         | －           | －           |
| 6    | 想定元本合計                   | 63,600      | 65,600      |
| 公正価値 |                          |             |             |
| 7    | プラスの公正価値（資産）             | 72          | 1,009       |
| 8    | マイナスの公正価値（負債）            | △ 995       | △ 58        |

(単位：百万円)

| CCR6 |                          | 2019年9月末    |             |
|------|--------------------------|-------------|-------------|
| 項番   |                          | イ           | ロ           |
|      |                          | 購入したプロテクション | 提供したプロテクション |
| 想定元本 |                          |             |             |
| 1    | シングルネーム・クレジット・デフォルト・スワップ | 52,579      | 77,339      |
| 2    | インデックス・クレジット・デフォルト・スワップ  | 4,720       | —           |
| 3    | トータル・リターン・スワップ           | —           | —           |
| 4    | クレジットオプション               | —           | —           |
| 5    | その他のクレジット・デリバティブ         | —           | —           |
| 6    | 想定元本合計                   | 57,300      | 77,339      |
| 公正価値 |                          |             |             |
| 7    | プラスの公正価値（資産）             | 25          | 1,070       |
| 8    | マイナスの公正価値（負債）            | △ 660       | △ 33        |

## CCR8：中央清算機関向けエクスポージャー

(単位：百万円)

| CCR8 |                                               | 2020年9月末                               |            |
|------|-----------------------------------------------|----------------------------------------|------------|
| 項番   |                                               | イ                                      | ロ          |
|      |                                               | 中央清算機関向け<br>エクスポージャー<br>(信用リスク削減手法適用後) | リスク・アセットの額 |
| 1    | 適格中央清算機関へのエクスポージャー（合計）                        |                                        | 52,555     |
| 2    | 適格中央清算機関に対するトレード・エクスポージャー<br>(当初証拠金を除く。)      | 1,838,935                              | 36,778     |
| 3    | (i) 派生商品取引（上場以外）                              | 1,670,261                              | 33,405     |
| 4    | (ii) 派生商品取引（上場）                               | 108,479                                | 2,169      |
| 5    | (iii) レポ形式の取引                                 | 60,194                                 | 1,203      |
| 6    | (iv) クロスプロダクト・ネットティングが承認された場合の<br>ネットティング・セット | —                                      | —          |
| 7    | 分別管理されている当初証拠金                                | —                                      | —          |
| 8    | 分別管理されていない当初証拠金                               | 156,428                                | 3,128      |
| 9    | 事前拋出された清算基金                                   | 20,943                                 | 12,648     |
| 10   | 未拋出の清算基金                                      | —                                      | —          |
| 11   | 非適格中央清算機関へのエクスポージャー（合計）                       |                                        | —          |
| 12   | 非適格中央清算機関に対するトレード・エクスポージャー<br>(当初証拠金を除く。)     | —                                      | —          |
| 13   | (i) 派生商品取引（上場以外）                              | —                                      | —          |
| 14   | (ii) 派生商品取引（上場）                               | —                                      | —          |
| 15   | (iii) レポ形式の取引                                 | —                                      | —          |
| 16   | (iv) クロスプロダクト・ネットティングが承認された場合の<br>ネットティング・セット | —                                      | —          |
| 17   | 分別管理されている当初証拠金                                | —                                      | —          |
| 18   | 分別管理されていない当初証拠金                               | —                                      | —          |
| 19   | 事前拋出された清算基金                                   | —                                      | —          |
| 20   | 未拋出の清算基金                                      | —                                      | —          |

三井住友トラスト・  
ホールディングス  
決算データ三井住友信託銀行  
決算データ三井住友トラスト・  
ホールディングス  
バーゼルⅢ関連データ三井住友信託銀行  
バーゼルⅢ関連データ開  
示  
項  
目  
一  
覧

(単位：百万円)

| CCR8 |                                               | 2019年9月末                               |            |
|------|-----------------------------------------------|----------------------------------------|------------|
| 項番   |                                               | イ                                      | ロ          |
|      |                                               | 中央清算機関向け<br>エクスポージャー<br>(信用リスク削減手法適用後) | リスク・アセットの額 |
| 1    | 適格中央清算機関へのエクスポージャー（合計）                        |                                        | 47,669     |
| 2    | 適格中央清算機関に対するトレード・エクスポージャー<br>(当初証拠金を除く。)      | 1,313,493                              | 26,269     |
| 3    | (i) 派生商品取引（上場以外）                              | 1,162,311                              | 23,246     |
| 4    | (ii) 派生商品取引（上場）                               | 111,606                                | 2,232      |
| 5    | (iii) レポ形式の取引                                 | 39,575                                 | 791        |
| 6    | (iv) クロスプロダクト・ネットティングが承認された場合の<br>ネットティング・セット | —                                      | —          |
| 7    | 分別管理されている当初証拠金                                | —                                      |            |
| 8    | 分別管理されていない当初証拠金                               | 72,418                                 | 1,448      |
| 9    | 事前拋出された清算基金                                   | 22,353                                 | 19,950     |
| 10   | 未拋出の清算基金                                      | —                                      | —          |
| 11   | 非適格中央清算機関へのエクスポージャー（合計）                       |                                        | —          |
| 12   | 非適格中央清算機関に対するトレード・エクスポージャー<br>(当初証拠金を除く。)     | —                                      | —          |
| 13   | (i) 派生商品取引（上場以外）                              | —                                      | —          |
| 14   | (ii) 派生商品取引（上場）                               | —                                      | —          |
| 15   | (iii) レポ形式の取引                                 | —                                      | —          |
| 16   | (iv) クロスプロダクト・ネットティングが承認された場合の<br>ネットティング・セット | —                                      | —          |
| 17   | 分別管理されている当初証拠金                                | —                                      |            |
| 18   | 分別管理されていない当初証拠金                               | —                                      | —          |
| 19   | 事前拋出された清算基金                                   | —                                      | —          |
| 20   | 未拋出の清算基金                                      | —                                      | —          |

三井住友トラスト・  
ホールディングス  
決算データ三井住友信託銀行  
決算データ三井住友トラスト・  
ホールディングス  
バーゼルIII関連データ三井住友信託銀行  
バーゼルIII関連データ

開示項目一覧

# SEC1：原資産の種類別の証券化エクスポージャー（信用リスク・アセットの額の算出対象となっている証券化エクスポージャーに限る。）

(単位：百万円)

| SEC1 |                        | 2020年9月末       |              |        |                |              |         |                |              |         |
|------|------------------------|----------------|--------------|--------|----------------|--------------|---------|----------------|--------------|---------|
| 項番   | 原資産の種類                 | イ              | ロ            | ハ      | ニ              | ホ            | ヘ       | ト              | チ            | リ       |
|      |                        | 自金融機関がオリジネーター  |              |        | 自金融機関がスポンサー    |              |         | 自金融機関が投資家      |              |         |
|      |                        | 資産譲渡型<br>証券化取引 | 合成型<br>証券化取引 | 小計     | 資産譲渡型<br>証券化取引 | 合成型<br>証券化取引 | 小計      | 資産譲渡型<br>証券化取引 | 合成型<br>証券化取引 | 小計      |
| 1    | リテール（合計）               | 71,425         | —            | 71,425 | 267,509        | —            | 267,509 | 111,826        | —            | 111,826 |
| 2    | 担保付住宅ローン               | 71,425         | —            | 71,425 | 80,101         | —            | 80,101  | 64,477         | —            | 64,477  |
| 3    | クレジットカード債権             | —              | —            | —      | 22,221         | —            | 22,221  | 23,794         | —            | 23,794  |
| 4    | その他リテールに係る<br>エクスポージャー | —              | —            | —      | 165,186        | —            | 165,186 | 23,553         | —            | 23,553  |
| 5    | 再証券化                   | —              | —            | —      | —              | —            | —       | —              | —            | —       |
| 6    | ホールセール（合計）             | 5,409          | —            | 5,409  | —              | —            | —       | 679,759        | —            | 679,759 |
| 7    | 事業法人向けローン              | —              | —            | —      | —              | —            | —       | 679,759        | —            | 679,759 |
| 8    | 商業用モーゲージ担保証券           | —              | —            | —      | —              | —            | —       | —              | —            | —       |
| 9    | リース債権及び売掛債権            | 5,409          | —            | 5,409  | —              | —            | —       | —              | —            | —       |
| 10   | その他のホールセール             | —              | —            | —      | —              | —            | —       | —              | —            | —       |
| 11   | 再証券化                   | —              | —            | —      | —              | —            | —       | —              | —            | —       |

(単位：百万円)

| SEC1 |                        | 2019年9月末       |              |        |                |              |         |                |              |         |
|------|------------------------|----------------|--------------|--------|----------------|--------------|---------|----------------|--------------|---------|
| 項番   | 原資産の種類                 | イ              | ロ            | ハ      | ニ              | ホ            | ヘ       | ト              | チ            | リ       |
|      |                        | 自金融機関がオリジネーター  |              |        | 自金融機関がスポンサー    |              |         | 自金融機関が投資家      |              |         |
|      |                        | 資産譲渡型<br>証券化取引 | 合成型<br>証券化取引 | 小計     | 資産譲渡型<br>証券化取引 | 合成型<br>証券化取引 | 小計      | 資産譲渡型<br>証券化取引 | 合成型<br>証券化取引 | 小計      |
| 1    | リテール（合計）               | 59,721         | —            | 59,721 | 172,186        | —            | 172,186 | 182,641        | —            | 182,641 |
| 2    | 担保付住宅ローン               | 59,721         | —            | 59,721 | 84,675         | —            | 84,675  | 80,336         | —            | 80,336  |
| 3    | クレジットカード債権             | —              | —            | —      | 1,320          | —            | 1,320   | 34,103         | —            | 34,103  |
| 4    | その他リテールに係る<br>エクスポージャー | —              | —            | —      | 86,191         | —            | 86,191  | 68,201         | —            | 68,201  |
| 5    | 再証券化                   | —              | —            | —      | —              | —            | —       | —              | —            | —       |
| 6    | ホールセール（合計）             | 16,677         | —            | 16,677 | —              | —            | —       | 783,151        | —            | 783,151 |
| 7    | 事業法人向けローン              | —              | —            | —      | —              | —            | —       | 761,554        | —            | 761,554 |
| 8    | 商業用モーゲージ担保証券           | —              | —            | —      | —              | —            | —       | —              | —            | —       |
| 9    | リース債権及び売掛債権            | 16,677         | —            | 16,677 | —              | —            | —       | 21,596         | —            | 21,596  |
| 10   | その他のホールセール             | —              | —            | —      | —              | —            | —       | —              | —            | —       |
| 11   | 再証券化                   | —              | —            | —      | —              | —            | —       | —              | —            | —       |

## SEC2：原資産の種類別の証券化エクスポージャー（マーケット・リスク相当額の算出対象となっている証券化エクスポージャーに限る。）

2020年9月末  
該当ありません。

2019年9月末  
該当ありません。

三井住友トラスト・  
ホールディングス  
決算データ三井住友信託銀行  
決算データ三井住友トラスト・  
ホールディングス  
パーゼル川関連データ三井住友信託銀行  
パーゼル川関連データ

開示項目一覧

# SEC3：信用リスク・アセットの額の算出対象となる証券化エクスポージャー及び関連する所要自己資本 (自金融機関がオリジネーター又はスポンサーである場合)

(単位：百万円)

| SEC3                    |                                               | 2020年9月末       |                |         |         |        |      |   |                |        |              |      |      |   |   |   |
|-------------------------|-----------------------------------------------|----------------|----------------|---------|---------|--------|------|---|----------------|--------|--------------|------|------|---|---|---|
| 項番                      |                                               | イ              | ロ              | ハ       | ニ       | ホ      | ヘ    | ト | チ              | リ      | ヌ            | ル    | ヲ    | ワ | カ | ヨ |
|                         |                                               | 合計             |                |         |         |        |      |   |                |        |              |      |      |   |   |   |
|                         |                                               | 資産譲渡型証券化取引（小計） |                |         |         |        |      |   |                |        | 合成型証券化取引（小計） |      |      |   |   |   |
|                         |                                               | 証券化            |                |         |         | 再証券化   |      |   | 証券化            |        |              | 再証券化 |      |   |   |   |
|                         |                                               |                | 裏付けとなる<br>リテール | ホールセール  |         | シニア    | 非シニア |   | 裏付けとなる<br>リテール | ホールセール |              | シニア  | 非シニア |   |   |   |
| エクスポージャーの額（リスク・ウェイト区分別） |                                               |                |                |         |         |        |      |   |                |        |              |      |      |   |   |   |
| 1                       | 20%以下のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー               | 225,200        | 225,200        | 225,200 | 225,200 | —      | —    | — | —              | —      | —            | —    | —    | — | — | — |
| 2                       | 20%超50%以下のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー           | 42,268         | 42,268         | 42,268  | 42,268  | —      | —    | — | —              | —      | —            | —    | —    | — | — | — |
| 3                       | 50%超100%以下のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー          | 55,253         | 55,253         | 55,253  | 55,253  | —      | —    | — | —              | —      | —            | —    | —    | — | — | — |
| 4                       | 100%超1,250%未満のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー       | 21,563         | 21,563         | 21,563  | 16,154  | 5,409  | —    | — | —              | —      | —            | —    | —    | — | — | — |
| 5                       | 1,250%のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー              | 59             | 59             | 59      | 59      | —      | —    | — | —              | —      | —            | —    | —    | — | — | — |
| エクスポージャーの額（算出方法別）       |                                               |                |                |         |         |        |      |   |                |        |              |      |      |   |   |   |
| 6                       | 内部格付手法準拠方式又は内部評価方式が適用される証券化エクスポージャー           | 343,267        | 343,267        | 343,267 | 337,857 | 5,409  | —    | — | —              | —      | —            | —    | —    | — | — | — |
| 7                       | 外部格付準拠方式が適用される証券化エクスポージャー                     | 1,018          | 1,018          | 1,018   | 1,018   | —      | —    | — | —              | —      | —            | —    | —    | — | — | — |
| 8                       | 標準的手法準拠方式が適用される証券化エクスポージャー                    | —              | —              | —       | —       | —      | —    | — | —              | —      | —            | —    | —    | — | — | — |
| 9                       | 1,250%のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー              | 59             | 59             | 59      | 59      | —      | —    | — | —              | —      | —            | —    | —    | — | — | — |
| 信用リスク・アセットの額（算出方法別）     |                                               |                |                |         |         |        |      |   |                |        |              |      |      |   |   |   |
| 10                      | 内部格付手法準拠方式又は内部評価方式により算出した信用リスク・アセット           | 156,977        | 156,977        | 156,977 | 114,685 | 42,291 | —    | — | —              | —      | —            | —    | —    | — | — | — |
| 11                      | 外部格付準拠方式により算出した信用リスク・アセット                     | 280            | 280            | 280     | 280     | —      | —    | — | —              | —      | —            | —    | —    | — | — | — |
| 12                      | 標準的手法準拠方式により算出した信用リスク・アセット                    | —              | —              | —       | —       | —      | —    | — | —              | —      | —            | —    | —    | — | — | — |
| 13                      | 1,250%のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャーに係る信用リスク・アセット | 739            | 739            | 739     | 739     | —      | —    | — | —              | —      | —            | —    | —    | — | — | — |
| 所要自己資本の額（算出方法別）         |                                               |                |                |         |         |        |      |   |                |        |              |      |      |   |   |   |
| 14                      | 内部格付手法準拠方式又は内部評価方式が適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本  | 12,558         | 12,558         | 12,558  | 9,174   | 3,383  | —    | — | —              | —      | —            | —    | —    | — | — | — |
| 15                      | 外部格付準拠方式が適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本            | 22             | 22             | 22      | 22      | —      | —    | — | —              | —      | —            | —    | —    | — | — | — |
| 16                      | 標準的手法準拠方式が適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本           | —              | —              | —       | —       | —      | —    | — | —              | —      | —            | —    | —    | — | — | — |
| 17                      | 1,250%のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本     | 59             | 59             | 59      | 59      | —      | —    | — | —              | —      | —            | —    | —    | — | — | — |

(単位：百万円)

| SEC3                    |                                               | 2019年9月末       |         |               |         |        |   |     |      |              |   |               |        |      |     |      |
|-------------------------|-----------------------------------------------|----------------|---------|---------------|---------|--------|---|-----|------|--------------|---|---------------|--------|------|-----|------|
| 項番                      |                                               | イ              | ロ       | ハ             | ニ       | ホ      | ヘ | ト   | チ    | リ            | ヌ | ル             | ヲ      | ワ    | カ   | ヨ    |
|                         |                                               | 合計             |         |               |         |        |   |     |      |              |   |               |        |      |     |      |
|                         |                                               | 資産譲渡型証券化取引（小計） |         |               |         |        |   |     |      | 合成型証券化取引（小計） |   |               |        |      |     |      |
|                         |                                               | 証券化            |         |               |         | 再証券化   |   |     |      | 証券化          |   |               |        | 再証券化 |     |      |
|                         |                                               |                |         | 裏付けとなる<br>リート | ホールセール  |        |   | シニア | 非シニア |              |   | 裏付けとなる<br>リート | ホールセール |      | シニア | 非シニア |
| エクスポージャーの額（リスク・ウェイト区分別） |                                               |                |         |               |         |        |   |     |      |              |   |               |        |      |     |      |
| 1                       | 20%以下のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー               | 110,167        | 110,167 | 110,167       | 110,167 | —      | — | —   | —    | —            | — | —             | —      | —    | —   | —    |
| 2                       | 20%超50%以下のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー           | 63,427         | 63,427  | 63,427        | 63,427  | —      | — | —   | —    | —            | — | —             | —      | —    | —   | —    |
| 3                       | 50%超100%以下のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー          | 42,512         | 42,512  | 42,512        | 42,512  | —      | — | —   | —    | —            | — | —             | —      | —    | —   | —    |
| 4                       | 100%超1,250%未満のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー       | 32,392         | 32,392  | 32,392        | 15,715  | 16,677 | — | —   | —    | —            | — | —             | —      | —    | —   | —    |
| 5                       | 1,250%のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー              | 86             | 86      | 86            | 86      | —      | — | —   | —    | —            | — | —             | —      | —    | —   | —    |
| エクスポージャーの額（算出方法別）       |                                               |                |         |               |         |        |   |     |      |              |   |               |        |      |     |      |
| 6                       | 内部格付手法準拠方式又は内部評価方式が適用される証券化エクスポージャー           | 247,744        | 247,744 | 247,744       | 231,067 | 16,677 | — | —   | —    | —            | — | —             | —      | —    | —   | —    |
| 7                       | 外部格付準拠方式が適用される証券化エクスポージャー                     | 754            | 754     | 754           | 754     | —      | — | —   | —    | —            | — | —             | —      | —    | —   | —    |
| 8                       | 標準的手法準拠方式が適用される証券化エクスポージャー                    | —              | —       | —             | —       | —      | — | —   | —    | —            | — | —             | —      | —    | —   | —    |
| 9                       | 1,250%のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー              | 86             | 86      | 86            | 86      | —      | — | —   | —    | —            | — | —             | —      | —    | —   | —    |
| 信用リスク・アセットの額（算出方法別）     |                                               |                |         |               |         |        |   |     |      |              |   |               |        |      |     |      |
| 10                      | 内部格付手法準拠方式又は内部評価方式により算出した信用リスク・アセット           | 154,281        | 154,281 | 154,281       | 106,883 | 47,398 | — | —   | —    | —            | — | —             | —      | —    | —   | —    |
| 11                      | 外部格付準拠方式により算出した信用リスク・アセット                     | 154            | 154     | 154           | 154     | —      | — | —   | —    | —            | — | —             | —      | —    | —   | —    |
| 12                      | 標準的手法準拠方式により算出した信用リスク・アセット                    | —              | —       | —             | —       | —      | — | —   | —    | —            | — | —             | —      | —    | —   | —    |
| 13                      | 1,250%のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャーに係る信用リスク・アセット | 1,080          | 1,080   | 1,080         | 1,080   | —      | — | —   | —    | —            | — | —             | —      | —    | —   | —    |
| 所要自己資本の額（算出方法別）         |                                               |                |         |               |         |        |   |     |      |              |   |               |        |      |     |      |
| 14                      | 内部格付手法準拠方式又は内部評価方式が適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本  | 12,341         | 12,341  | 12,341        | 8,550   | 3,791  | — | —   | —    | —            | — | —             | —      | —    | —   | —    |
| 15                      | 外部格付準拠方式が適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本            | 12             | 12      | 12            | 12      | —      | — | —   | —    | —            | — | —             | —      | —    | —   | —    |
| 16                      | 標準的手法準拠方式が適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本           | —              | —       | —             | —       | —      | — | —   | —    | —            | — | —             | —      | —    | —   | —    |
| 17                      | 1,250%のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本     | 86             | 86      | 86            | 86      | —      | — | —   | —    | —            | — | —             | —      | —    | —   | —    |

三井住友トラスト・ホールディングス  
決算データ三井住友信託銀行  
決算データ三井住友トラスト・ホールディングス  
パーゼル川関連データ三井住友信託銀行  
パーゼル川関連データ

開示項目一覧

# SEC4：信用リスク・アセットの額の算出対象となる証券化エクスポージャー及び関連する所要自己資本 (自金融機関が投資家である場合)

(単位：百万円)

| SEC4                    |                                               | 2020年9月末       |         |                |        |         |   |      |      |   |              |                |        |      |     |      |
|-------------------------|-----------------------------------------------|----------------|---------|----------------|--------|---------|---|------|------|---|--------------|----------------|--------|------|-----|------|
| 項番                      |                                               | イ              | ロ       | ハ              | ニ      | ホ       | ヘ | ト    | チ    | リ | ヌ            | ル              | ヲ      | ワ    | カ   | ヨ    |
|                         |                                               | 合計             |         |                |        |         |   |      |      |   |              |                |        |      |     |      |
|                         |                                               | 資産譲渡型証券化取引（小計） |         |                |        |         |   |      |      |   | 合成型証券化取引（小計） |                |        |      |     |      |
|                         |                                               | 証券化            |         |                | 再証券化   |         |   | 再証券化 |      |   | 証券化          |                |        | 再証券化 |     |      |
|                         |                                               |                |         | 裏付けとなる<br>リテール | ホールセール |         |   | シニア  | 非シニア |   |              | 裏付けとなる<br>リテール | ホールセール |      | シニア | 非シニア |
| エクスポージャーの額（リスク・ウェイト区分別） |                                               |                |         |                |        |         |   |      |      |   |              |                |        |      |     |      |
| 1                       | 20%以下のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー               | 680,245        | 680,245 | 680,245        | 79,434 | 600,810 | — | —    | —    | — | —            | —              | —      | —    | —   | —    |
| 2                       | 20%超50%以下のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー           | 68,419         | 68,419  | 68,419         | 16,476 | 51,942  | — | —    | —    | — | —            | —              | —      | —    | —   | —    |
| 3                       | 50%超100%以下のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー          | 33,424         | 33,424  | 33,424         | 6,419  | 27,005  | — | —    | —    | — | —            | —              | —      | —    | —   | —    |
| 4                       | 100%超1,250%未満のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー       | 9,496          | 9,496   | 9,496          | 9,496  | —       | — | —    | —    | — | —            | —              | —      | —    | —   | —    |
| 5                       | 1,250%のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー              | 0              | 0       | 0              | 0      | —       | — | —    | —    | — | —            | —              | —      | —    | —   | —    |
| エクスポージャーの額（算出方法別）       |                                               |                |         |                |        |         |   |      |      |   |              |                |        |      |     |      |
| 6                       | 内部格付手法準拠方式又は内部評価方式が適用される証券化エクスポージャー           | 752,440        | 752,440 | 752,440        | 72,681 | 679,759 | — | —    | —    | — | —            | —              | —      | —    | —   | —    |
| 7                       | 外部格付準拠方式が適用される証券化エクスポージャー                     | 39,144         | 39,144  | 39,144         | 39,144 | —       | — | —    | —    | — | —            | —              | —      | —    | —   | —    |
| 8                       | 標準的手法準拠方式が適用される証券化エクスポージャー                    | —              | —       | —              | —      | —       | — | —    | —    | — | —            | —              | —      | —    | —   | —    |
| 9                       | 1,250%のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー              | 0              | 0       | 0              | 0      | —       | — | —    | —    | — | —            | —              | —      | —    | —   | —    |
| 信用リスク・アセットの額（算出方法別）     |                                               |                |         |                |        |         |   |      |      |   |              |                |        |      |     |      |
| 10                      | 内部格付手法準拠方式又は内部評価方式により算出した信用リスク・アセット           | 138,211        | 138,211 | 138,211        | 16,051 | 122,159 | — | —    | —    | — | —            | —              | —      | —    | —   | —    |
| 11                      | 外部格付準拠方式により算出した信用リスク・アセット                     | 17,776         | 17,776  | 17,776         | 17,776 | —       | — | —    | —    | — | —            | —              | —      | —    | —   | —    |
| 12                      | 標準的手法準拠方式により算出した信用リスク・アセット                    | —              | —       | —              | —      | —       | — | —    | —    | — | —            | —              | —      | —    | —   | —    |
| 13                      | 1,250%のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャーに係る信用リスク・アセット | 0              | 0       | 0              | 0      | —       | — | —    | —    | — | —            | —              | —      | —    | —   | —    |
| 所要自己資本の額（算出方法別）         |                                               |                |         |                |        |         |   |      |      |   |              |                |        |      |     |      |
| 14                      | 内部格付手法準拠方式又は内部評価方式が適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本  | 11,056         | 11,056  | 11,056         | 1,284  | 9,772   | — | —    | —    | — | —            | —              | —      | —    | —   | —    |
| 15                      | 外部格付準拠方式が適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本            | 1,422          | 1,422   | 1,422          | 1,422  | —       | — | —    | —    | — | —            | —              | —      | —    | —   | —    |
| 16                      | 標準的手法準拠方式が適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本           | —              | —       | —              | —      | —       | — | —    | —    | — | —            | —              | —      | —    | —   | —    |
| 17                      | 1,250%のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本     | 0              | 0       | 0              | 0      | —       | — | —    | —    | — | —            | —              | —      | —    | —   | —    |

(単位：百万円)

| SEC4                    |                                               | 2019年9月末       |         |                |         |         |   |     |      |              |   |                |        |      |     |      |
|-------------------------|-----------------------------------------------|----------------|---------|----------------|---------|---------|---|-----|------|--------------|---|----------------|--------|------|-----|------|
| 項番                      |                                               | イ              | ロ       | ハ              | ニ       | ホ       | ヘ | ト   | チ    | リ            | ヌ | ル              | ヲ      | ワ    | カ   | ヨ    |
|                         |                                               | 合計             |         |                |         |         |   |     |      |              |   |                |        |      |     |      |
|                         |                                               | 資産譲渡型証券化取引（小計） |         |                |         |         |   |     |      | 合成型証券化取引（小計） |   |                |        |      |     |      |
|                         |                                               | 証券化            |         |                |         | 再証券化    |   |     |      | 証券化          |   |                |        | 再証券化 |     |      |
|                         |                                               |                |         | 裏付けとなる<br>リテール | ホールセール  |         |   | シニア | 非シニア |              |   | 裏付けとなる<br>リテール | ホールセール |      | シニア | 非シニア |
| エクスポージャーの額（リスク・ウェイト区分別） |                                               |                |         |                |         |         |   |     |      |              |   |                |        |      |     |      |
| 1                       | 20%以下のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー               | 834,440        | 834,440 | 834,440        | 148,950 | 685,490 | — | —   | —    | —            | — | —              | —      | —    | —   | —    |
| 2                       | 20%超50%以下のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー           | 75,853         | 75,853  | 75,853         | 26,531  | 49,322  | — | —   | —    | —            | — | —              | —      | —    | —   | —    |
| 3                       | 50%超100%以下のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー          | 51,916         | 51,916  | 51,916         | 3,579   | 48,337  | — | —   | —    | —            | — | —              | —      | —    | —   | —    |
| 4                       | 100%超1,250%未満のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー       | 3,580          | 3,580   | 3,580          | 3,580   | —       | — | —   | —    | —            | — | —              | —      | —    | —   | —    |
| 5                       | 1,250%のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー              | 0              | 0       | 0              | 0       | —       | — | —   | —    | —            | — | —              | —      | —    | —   | —    |
| エクスポージャーの額（算出方法別）       |                                               |                |         |                |         |         |   |     |      |              |   |                |        |      |     |      |
| 6                       | 内部格付手法準拠方式又は内部評価方式が適用される証券化エクスポージャー           | 920,760        | 920,760 | 920,760        | 137,609 | 783,151 | — | —   | —    | —            | — | —              | —      | —    | —   | —    |
| 7                       | 外部格付準拠方式が適用される証券化エクスポージャー                     | 45,031         | 45,031  | 45,031         | 45,031  | —       | — | —   | —    | —            | — | —              | —      | —    | —   | —    |
| 8                       | 標準的手法準拠方式が適用される証券化エクスポージャー                    | —              | —       | —              | —       | —       | — | —   | —    | —            | — | —              | —      | —    | —   | —    |
| 9                       | 1,250%のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー              | 0              | 0       | 0              | 0       | —       | — | —   | —    | —            | — | —              | —      | —    | —   | —    |
| 信用リスク・アセットの額（算出方法別）     |                                               |                |         |                |         |         |   |     |      |              |   |                |        |      |     |      |
| 10                      | 内部格付手法準拠方式又は内部評価方式により算出した信用リスク・アセット           | 177,373        | 177,373 | 177,373        | 29,189  | 148,184 | — | —   | —    | —            | — | —              | —      | —    | —   | —    |
| 11                      | 外部格付準拠方式により算出した信用リスク・アセット                     | 12,236         | 12,236  | 12,236         | 12,236  | —       | — | —   | —    | —            | — | —              | —      | —    | —   | —    |
| 12                      | 標準的手法準拠方式により算出した信用リスク・アセット                    | —              | —       | —              | —       | —       | — | —   | —    | —            | — | —              | —      | —    | —   | —    |
| 13                      | 1,250%のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャーに係る信用リスク・アセット | 0              | 0       | 0              | 0       | —       | — | —   | —    | —            | — | —              | —      | —    | —   | —    |
| 所要自己資本の額（算出方法別）         |                                               |                |         |                |         |         |   |     |      |              |   |                |        |      |     |      |
| 14                      | 内部格付手法準拠方式又は内部評価方式が適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本  | 14,189         | 14,189  | 14,189         | 2,335   | 11,854  | — | —   | —    | —            | — | —              | —      | —    | —   | —    |
| 15                      | 外部格付準拠方式が適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本            | 978            | 978     | 978            | 978     | —       | — | —   | —    | —            | — | —              | —      | —    | —   | —    |
| 16                      | 標準的手法準拠方式が適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本           | —              | —       | —              | —       | —       | — | —   | —    | —            | — | —              | —      | —    | —   | —    |
| 17                      | 1,250%のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本     | 0              | 0       | 0              | 0       | —       | — | —   | —    | —            | — | —              | —      | —    | —   | —    |

三井住友トラスト・ホールディングス  
決算データ三井住友信託銀行  
決算データ三井住友トラスト・ホールディングス  
パーゼル川関連データ三井住友信託銀行  
パーゼル川関連データ

開示項目一覧

## MR1：標準的方式によるマーケット・リスク相当額

(単位：百万円)

| MR1 |                         | 2020年9月末                       |
|-----|-------------------------|--------------------------------|
| 項番  |                         | リスク・アセット<br>(リスク相当額を8%で除して得た額) |
| 1   | 金利リスク（一般市場リスク及び個別リスク）の額 | 3,628                          |
| 2   | 株式リスク（一般市場リスク及び個別リスク）の額 | —                              |
| 3   | 外国為替リスクの額               | 8,650                          |
| 4   | コモディティ・リスクの額            | —                              |
|     | オプション取引                 |                                |
| 5   | 簡便法により算出した額             | —                              |
| 6   | デルタ・プラス法により算出した額        | —                              |
| 7   | シナリオ法により算出した額           | —                              |
| 8   | 証券化エクスポージャーに係る個別リスクの額   | —                              |
| 9   | 合計                      | 12,278                         |

(単位：百万円)

| MR1 |                         | 2019年9月末                       |
|-----|-------------------------|--------------------------------|
| 項番  |                         | リスク・アセット<br>(リスク相当額を8%で除して得た額) |
| 1   | 金利リスク（一般市場リスク及び個別リスク）の額 | 2,587                          |
| 2   | 株式リスク（一般市場リスク及び個別リスク）の額 | —                              |
| 3   | 外国為替リスクの額               | 9,188                          |
| 4   | コモディティ・リスクの額            | —                              |
|     | オプション取引                 |                                |
| 5   | 簡便法により算出した額             | —                              |
| 6   | デルタ・プラス法により算出した額        | —                              |
| 7   | シナリオ法により算出した額           | —                              |
| 8   | 証券化エクスポージャーに係る個別リスクの額   | —                              |
| 9   | 合計                      | 11,776                         |

三井住友トラスト・ホールディングス  
決算データ三井住友信託銀行  
決算データ三井住友トラスト・ホールディングス  
パーゼル川関連データ三井住友信託銀行  
パーゼル川関連データ

開示項目一覧

## MR3：内部モデル方式の状況（マーケット・リスク）

（単位：百万円）

| MR3                                      |              | 2020年9月末 |
|------------------------------------------|--------------|----------|
| 項番                                       |              |          |
| バリュー・アット・リスク（保有期間 10営業日、片側信頼区間 99%）      |              |          |
| 1                                        | 最大値          | 13,022   |
| 2                                        | 平均値          | 7,418    |
| 3                                        | 最小値          | 4,985    |
| 4                                        | 期末           | 5,092    |
| ストレス・バリュー・アット・リスク（保有期間 10営業日、片側信頼区間 99%） |              |          |
| 5                                        | 最大値          | 32,010   |
| 6                                        | 平均値          | 27,081   |
| 7                                        | 最小値          | 18,982   |
| 8                                        | 期末           | 26,695   |
| 追加的リスクの額（片側信頼区間 99.9%）                   |              |          |
| 9                                        | 最大値          | —        |
| 10                                       | 平均値          | —        |
| 11                                       | 最小値          | —        |
| 12                                       | 期末           | —        |
| 包括的リスクの額（片側信頼区間 99.9%）                   |              |          |
| 13                                       | 最大値          | —        |
| 14                                       | 平均値          | —        |
| 15                                       | 最小値          | —        |
| 16                                       | 期末           | —        |
| 17                                       | フロア（修正標準的方式） | —        |

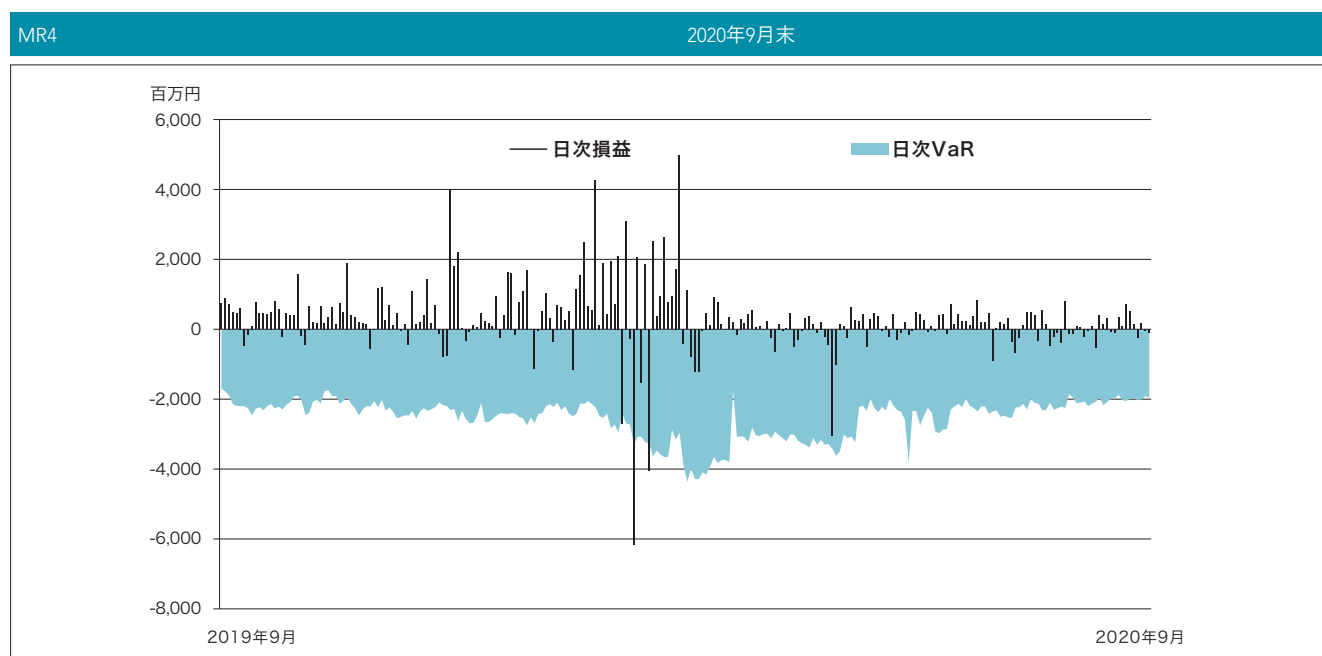
（単位：百万円）

| MR3                                      |              | 2019年9月末 |
|------------------------------------------|--------------|----------|
| 項番                                       |              |          |
| バリュー・アット・リスク（保有期間 10営業日、片側信頼区間 99%）      |              |          |
| 1                                        | 最大値          | 7,867    |
| 2                                        | 平均値          | 5,401    |
| 3                                        | 最小値          | 3,923    |
| 4                                        | 期末           | 4,595    |
| ストレス・バリュー・アット・リスク（保有期間 10営業日、片側信頼区間 99%） |              |          |
| 5                                        | 最大値          | 29,225   |
| 6                                        | 平均値          | 21,687   |
| 7                                        | 最小値          | 15,998   |
| 8                                        | 期末           | 19,484   |
| 追加的リスクの額（片側信頼区間 99.9%）                   |              |          |
| 9                                        | 最大値          | —        |
| 10                                       | 平均値          | —        |
| 11                                       | 最小値          | —        |
| 12                                       | 期末           | —        |
| 包括的リスクの額（片側信頼区間 99.9%）                   |              |          |
| 13                                       | 最大値          | —        |
| 14                                       | 平均値          | —        |
| 15                                       | 最小値          | —        |
| 16                                       | 期末           | —        |
| 17                                       | フロア（修正標準的方式） | —        |

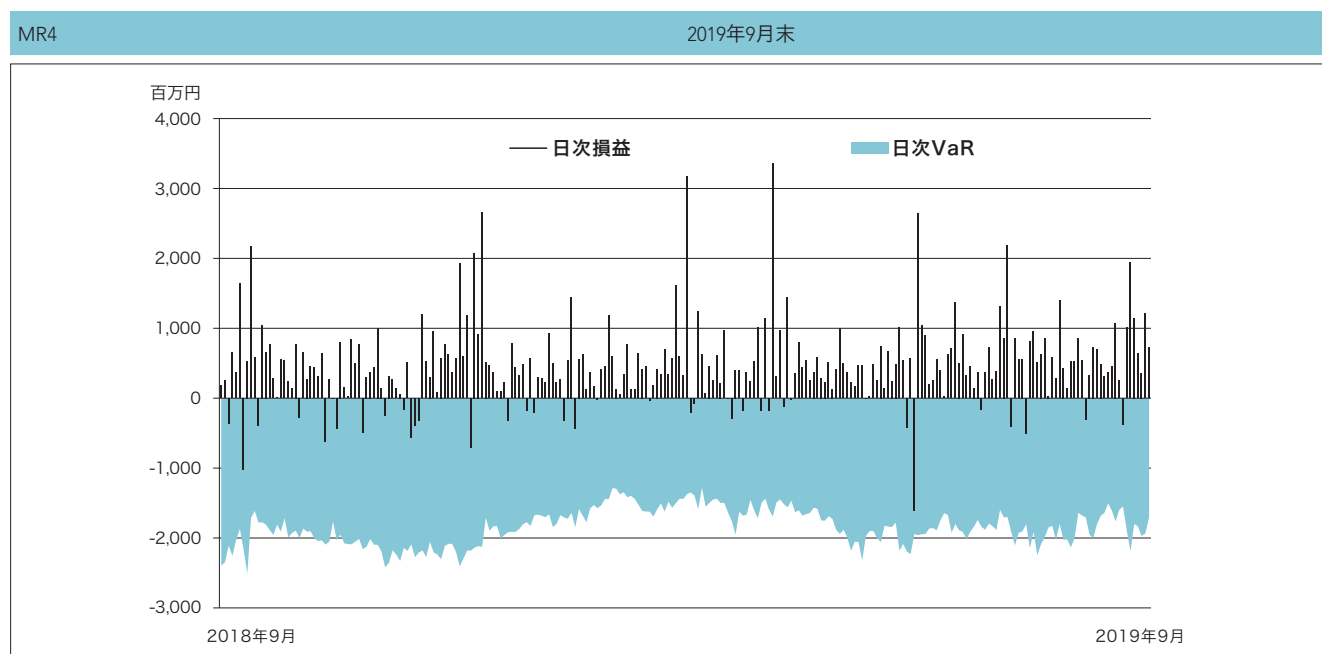
三井住友トラスト・ホールディングス  
決算データ三井住友信託銀行  
決算データ三井住友トラスト・ホールディングス  
パーゼル川関連データ三井住友信託銀行  
パーゼル川関連データ

開示項目一覧

## MR4：内部モデル方式のバック・テストの結果



(注) 1. 上記のとおり、報告期間において、バック・テストの超過は3回発生しております。



(注) 1. 上記のとおり、報告期間において、バック・テストの超過は発生しておりません。

## IRRBB1：金利リスク

(単位：百万円)

| IRRBB1 |            |           |          |           |          |
|--------|------------|-----------|----------|-----------|----------|
| 項番     |            | イ         | ロ        | ハ         | ニ        |
|        |            | ΔEVE      |          | ΔNII      |          |
|        |            | 2020年9月末  | 2019年9月末 | 2020年9月末  | 2019年9月末 |
| 1      | 上方パラレルシフト  | 100,975   | 131,376  | △ 79,552  | △ 57,616 |
| 2      | 下方パラレルシフト  | 24,754    | 19,616   | 76,126    | 59,076   |
| 3      | スティープ化     | 127,241   | 85,616   |           |          |
| 4      | フラット化      | 1,777     | —        |           |          |
| 5      | 短期金利上昇     | —         | 4,790    |           |          |
| 6      | 短期金利低下     | 44,304    | 17,008   |           |          |
| 7      | 最大値        | 127,241   | 131,376  | 76,126    | 59,076   |
|        |            | ホ         |          | ヘ         |          |
|        |            | 2020年9月末  |          | 2019年9月末  |          |
| 8      | Tier1 資本の額 | 2,454,860 |          | 2,466,947 |          |

三井住友トラスト・ホールディングス  
決算データ三井住友信託銀行  
決算データ三井住友トラスト・ホールディングス  
パーゼルIII関連データ三井住友信託銀行  
パーゼルIII関連データ

開示項目一覧

## 連結レバレッジ比率に関する開示事項

### 連結レバレッジ比率の構成に関する事項

(単位：百万円、%)

| 国際様式<br>(表2)の<br>該当番号               | 国際様式<br>(表1)の<br>該当番号 | 項目                                                     | 2020年9月末   | 2019年9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                                    | 41,738,879 | 54,313,361 |
| 1a                                  | 1                     | 連結貸借対照表における総資産の額                                       | 44,375,176 | 56,898,511 |
| 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 (△)                 | 2,636,296  | 2,585,149  |
| 2                                   | 7                     | Tier1資本に係る調整項目の額 (△)                                   | 146,003    | 203,323    |
| 3                                   |                       | オン・バランス資産の額 (イ)                                        | 41,592,876 | 54,110,038 |
| <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                                  | 535,796    | 474,861    |
| 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                                    | 937,540    | 936,164    |
|                                     |                       | 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                         | 516,924    | 425,309    |
| 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 (△)           | 190,551    | 86,781     |
| 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               | 65,600     | 77,339     |
| 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 (△)    | 63,600     | 57,300     |
| 11                                  | 4                     | デリバティブ取引等に関する額 (ロ)                                     | 1,801,710  | 1,769,594  |
| <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                                          | 924,627    | 900,489    |
| 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                      | 292,062    | 299,187    |
| 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)                                         | 1,216,689  | 1,199,676  |
| <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                                       | 8,192,722  | 7,551,019  |
| 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 (△)                     | 5,141,822  | 4,683,930  |
| 19                                  | 6                     | オフ・バランス取引に関する額 (ニ)                                     | 3,050,899  | 2,867,088  |
| <b>連結レバレッジ比率</b>                    |                       |                                                        |            |            |
| 20                                  |                       | 資本の額 (ホ)                                               | 2,454,860  | 2,466,947  |
| 21                                  | 8                     | 総エクスポージャーの額 ((イ) + (ロ) + (ハ) + (ニ)) (ヘ)                | 47,662,176 | 59,946,397 |
| 22                                  |                       | 連結レバレッジ比率 ((ホ) / (ヘ))                                  | 5.15%      | 4.11%      |
| <b>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</b> |                       |                                                        |            |            |
|                                     |                       | 総エクスポージャーの額 (ヘ)                                        | 47,662,176 |            |
|                                     |                       | 日本銀行に対する預け金の額                                          | 15,257,555 |            |
|                                     |                       | 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')                    | 62,919,731 |            |
|                                     |                       | 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'))              | 3.90%      |            |

(注) 1. 当社は連結レバレッジ比率の算定に関し、「自己資本比率及びレバレッジ比率の算定に対する合意された手続業務に関する実務指針」(日本公認会計士協会専門業務実務指針 4465 令和元年8月27日)に基づく外部監査を有限責任 あずさ監査法人より受けております。  
当該外部監査は連結財務諸表の監査又は財務報告に係る内部統制の監査の一部ではなく、当社と合意した範囲及び手続により外部監査人が実施し、その結果を当社宛に報告するものであります。外部監査人が連結レバレッジ比率そのものや連結レバレッジ比率の算定に係る内部統制について意見又は結論を表明するものではありません。

### 前中間連結会計期間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

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であります。

## 連結流動性カバレッジ比率に関する開示事項

## 連結流動性カバレッジ比率に関する定量的開示事項

(単位：百万円、%、件)

| 項 目             |                                          |                                                | 2020年度第2四半期  |              | 2020年度第1四半期  |              |
|-----------------|------------------------------------------|------------------------------------------------|--------------|--------------|--------------|--------------|
| 適格流動資産（１）       |                                          |                                                |              |              |              |              |
| 1               | 適格流動資産の合計額                               |                                                | 17,953,290   |              | 13,694,560   |              |
| 資金流出額（２）        |                                          |                                                | 資金流出率を乗じる前の額 | 資金流出率を乗じた後の額 | 資金流出率を乗じる前の額 | 資金流出率を乗じた後の額 |
| 2               | リテール無担保資金調達に係る資金流出額                      |                                                | 18,037,241   | 857,095      | 17,942,456   | 841,875      |
| 3               |                                          | うち、安定預金の額                                      | 769,901      | 23,097       | 735,409      | 22,062       |
| 4               |                                          | うち、準安定預金の額                                     | 8,301,187    | 833,998      | 8,157,764    | 819,813      |
| 5               | ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額                    |                                                | 13,335,886   | 10,519,740   | 12,813,688   | 10,509,075   |
| 6               |                                          | うち、適格オペレーショナル預金の額                              | —            | —            | —            | —            |
| 7               |                                          | うち、適格オペレーショナル預金、負債性有価証券以外のホールセール無担保資金調達に係る資金の額 | 10,973,207   | 8,157,061    | 10,608,334   | 8,303,721    |
| 8               |                                          | うち、負債性有価証券の額                                   | 2,362,679    | 2,362,679    | 2,205,354    | 2,205,354    |
| 9               | 有担保資金調達等に係る資金流出額                         |                                                |              | 56,526       |              | 108,950      |
| 10              | デリバティブ取引等、資金調達プログラム、与信・流動性ファシリティに係る資金流出額 |                                                | 6,372,472    | 1,697,577    | 5,788,145    | 1,638,593    |
| 11              |                                          | うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額                           | 338,398      | 338,398      | 334,674      | 334,674      |
| 12              |                                          | うち、資金調達プログラムに係る資金流出額                           | —            | —            | —            | —            |
| 13              |                                          | うち、与信・流動性ファシリティに係る資金流出額                        | 6,034,074    | 1,359,179    | 5,453,471    | 1,303,919    |
| 14              | 資金提供義務等に基づく資金流出額                         |                                                | 337,568      | 216,728      | 418,304      | 252,621      |
| 15              | 偶発事象に係る資金流出額                             |                                                | 11,359,679   | 22,293       | 10,749,934   | 23,709       |
| 16              | 資金流出合計額                                  |                                                |              | 13,369,959   |              | 13,374,823   |
| 資金流入額（３）        |                                          |                                                | 資金流入率を乗じる前の額 | 資金流入率を乗じた後の額 | 資金流入率を乗じる前の額 | 資金流入率を乗じた後の額 |
| 17              | 有担保資金運用等に係る資金流入額                         |                                                | 76,808       | —            | 473,934      | 6,377        |
| 18              | 貸付金等の回収に係る資金流入額                          |                                                | 2,977,314    | 2,118,404    | 2,630,945    | 1,787,715    |
| 19              | その他資金流入額                                 |                                                | 389,837      | 249,436      | 516,487      | 212,841      |
| 20              | 資金流入合計額                                  |                                                | 3,443,959    | 2,367,840    | 3,621,366    | 2,006,933    |
| 連結流動性カバレッジ比率（４） |                                          |                                                |              |              |              |              |
| 21              | 算入可能適格流動資産の合計額                           |                                                |              | 17,953,290   |              | 13,694,560   |
| 22              | 純資金流出額                                   |                                                |              | 11,002,119   |              | 11,367,890   |
| 23              | 連結流動性カバレッジ比率                             |                                                |              | 163.1        |              | 120.4        |
| 24              | 平均値計算用データ数                               |                                                |              | 61           |              | 61           |

## 連結流動性カバレッジ比率に関する定性的開示事項

- 時系列における連結流動性カバレッジ比率の変動に関する事項  
当社連結における過去2年間の流動性カバレッジ比率は、概ね安定的に推移しております。
- 連結流動性カバレッジ比率の水準の評価に関する事項  
当社連結の流動性カバレッジ比率は、流動性比率規制で定められる規制水準（100%）を満たしており、実績値は当初の見通しと大きく異なっておりません。また、今後の流動性カバレッジ比率の見直しは、現在の水準から大きく離れることは想定しておりません。
- 算入可能適格流動資産の合計額の内容に関する事項  
算入可能適格流動資産は中央銀行への預け金、国債等が大半を占めております。通貨または種類等の構成や所在地に著しい変動は発生しておりません。また、主要な通貨において、算入可能適格流動資産の合計額と純資金流出額の間に著しい通貨のミスマッチは発生しておりません。
- その他連結流動性カバレッジ比率に関する事項  
当社連結では、「適格オペレーショナル預金に係る特例」および「シナリオ法による時価変動時所要追加担保額」を適用しておりません。なお、連結流動性カバレッジ比率に与える影響に鑑み、重要性が低く、かつ、実務上の制約がある連結子会社については、日次データに代えて月末データを使用しております。

## KM1：主要な指標

(単位：百万円、%)

| KM1           |                |              |              |              |               |              |
|---------------|----------------|--------------|--------------|--------------|---------------|--------------|
| 国際様式の<br>該当番号 |                | イ            | ロ            | ハ            | ニ             | ホ            |
|               |                | 2020年<br>9月末 | 2020年<br>6月末 | 2020年<br>3月末 | 2019年<br>12月末 | 2019年<br>9月末 |
| 資本            |                |              |              |              |               |              |
| 1             | 普通株式等Tier1資本の額 | 1,874,965    | 1,855,453    | 1,853,206    | 1,925,493     | 1,912,687    |
| 2             | Tier1資本の額      | 2,214,965    | 2,195,453    | 2,193,206    | 2,265,493     | 2,252,687    |
| 3             | 総自己資本の額        | 2,736,073    | 2,682,377    | 2,693,326    | 2,771,187     | 2,769,965    |
| リスク・アセット      |                |              |              |              |               |              |
| 4             | リスク・アセットの額     | 18,653,915   | 18,538,841   | 18,113,159   | 18,825,656    | 18,149,949   |
| 自己資本比率        |                |              |              |              |               |              |
| 5             | 普通株式等Tier1比率   | 10.05%       | 10.00%       | 10.23%       | 10.22%        | 10.53%       |
| 6             | Tier1比率        | 11.87%       | 11.84%       | 12.10%       | 12.03%        | 12.41%       |
| 7             | 総自己資本比率        | 14.66%       | 14.46%       | 14.86%       | 14.72%        | 15.26%       |
| 単体レバレッジ比率     |                |              |              |              |               |              |
| 13            | 総エクスポージャーの額    | 45,805,095   | 46,661,133   | 57,397,289   | 56,211,082    | 58,115,701   |
| 14            | 単体レバレッジ比率      | 4.83%        | 4.70%        | 3.82%        | 4.03%         | 3.87%        |

(単位：百万円、%)

| KM1           |                 |                 |                 |                 |                 |                 |
|---------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| 国際様式の<br>該当番号 |                 | イ               | ロ               | ハ               | ニ               | ホ               |
|               |                 | 2020年度<br>第2四半期 | 2020年度<br>第1四半期 | 2019年度<br>第4四半期 | 2019年度<br>第3四半期 | 2019年度<br>第2四半期 |
| 単体流動性カバレッジ比率  |                 |                 |                 |                 |                 |                 |
| 15            | 算入可能適格流動性資産の合計額 | 17,661,017      | 13,401,434      | 14,166,020      | 15,025,280      | 15,251,414      |
| 16            | 純資金流出額          | 10,139,836      | 10,303,471      | 10,353,796      | 10,997,609      | 10,783,358      |
| 17            | 単体流動性カバレッジ比率    | 174.1%          | 130.0%          | 136.8%          | 136.6%          | 141.4%          |

(注) 1. 2019年度第2四半期においては日次データを用いるべき項目の一部を月末データで代用し算出しております。

# 自己資本の構成に関する開示事項（単体自己資本比率）

## CC1：自己資本の構成

（単位：百万円、％）

| CC1                 |                                                |           |           |                            |
|---------------------|------------------------------------------------|-----------|-----------|----------------------------|
| 国際様式の<br>該当番号       | 項 目                                            | イ         | ロ         | ハ                          |
|                     |                                                | 2020年9月末  | 2019年9月末  | 別紙様式<br>第十三号（CC2）の<br>参照項目 |
| 普通株式等Tier1資本に係る基礎項目 |                                                |           |           |                            |
| 1a+2-1c-26          | 普通株式に係る株主資本の額                                  | 1,718,740 | 1,665,537 |                            |
| 1a                  | うち、資本金及び資本剰余金の額                                | 685,103   | 685,103   |                            |
| 2                   | うち、利益剰余金の額                                     | 1,061,769 | 1,037,703 |                            |
| 1c                  | うち、自己株式の額（△）                                   | —         | —         |                            |
| 26                  | うち、社外流出予定額（△）                                  | 28,132    | 57,269    |                            |
|                     | うち、上記以外に該当するものの額                               | —         | —         |                            |
| 1b                  | 普通株式に係る新株予約権の額                                 | —         | —         |                            |
| 3                   | 評価・換算差額等及びその他公表準備金の額                           | 301,548   | 402,842   | (a)                        |
| 6                   | 普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額（イ）                       | 2,020,288 | 2,068,379 |                            |
| 普通株式等Tier1資本に係る調整項目 |                                                |           |           |                            |
| 8+9                 | 無形固定資産（モーゲージ・サービシング・ライツに係るものを除く。）の額の合計額        | 50,722    | 48,297    |                            |
| 8                   | うち、のれんに係るものの額                                  | —         | —         |                            |
| 9                   | うち、のれん及びモーゲージ・サービシング・ライツに係るもの以外のものの額           | 50,722    | 48,297    |                            |
| 10                  | 繰延税金資産（一時差異に係るものを除く。）の額                        | —         | —         |                            |
| 11                  | 繰延ヘッジ損益の額                                      | △ 39,538  | △ 34,585  |                            |
| 12                  | 適格引当金不足額                                       | —         | 16,352    |                            |
| 13                  | 証券化取引に伴い増加した自己資本に相当する額                         | 1,160     | 1,324     |                            |
| 14                  | 負債の時価評価により生じた時価評価差額であって自己資本に算入される額             | —         | —         |                            |
| 15                  | 前払年金費用の額                                       | 132,978   | 124,301   |                            |
| 16                  | 自己保有普通株式（純資産の部に計上されるものを除く。）の額                  | —         | —         |                            |
| 17                  | 意図的に保有している他の金融機関等の普通株式の額                       | —         | —         |                            |
| 18                  | 少数出資金融機関等の普通株式の額                               | —         | —         |                            |
| 19+20+21            | 特定項目に係る十パーセント基準超過額                             | —         | —         |                            |
| 19                  | うち、その他金融機関等に係る対象資本等調達手段のうち普通株式に該当するものに関連するものの額 | —         | —         |                            |
| 20                  | うち、無形固定資産（モーゲージ・サービシング・ライツに係るものに限る。）に関連するものの額  | —         | —         |                            |
| 21                  | うち、繰延税金資産（一時差異に係るものに限る。）に関連するものの額              | —         | —         |                            |
| 22                  | 特定項目に係る十五パーセント基準超過額                            | —         | —         |                            |
| 23                  | うち、その他金融機関等に係る対象資本等調達手段のうち普通株式に該当するものに関連するものの額 | —         | —         |                            |
| 24                  | うち、無形固定資産（モーゲージ・サービシング・ライツに係るものに限る。）に関連するものの額  | —         | —         |                            |
| 25                  | うち、繰延税金資産（一時差異に係るものに限る。）に関連するものの額              | —         | —         |                            |
| 27                  | その他Tier1資本不足額                                  | —         | —         |                            |
| 28                  | 普通株式等Tier1資本に係る調整項目の額（ロ）                       | 145,322   | 155,691   |                            |
| 普通株式等Tier1資本        |                                                |           |           |                            |
| 29                  | 普通株式等Tier1資本の額（（イ）－（ロ））（ハ）                     | 1,874,965 | 1,912,687 |                            |

三井住友トラスト・ホールディングス  
決算データ

三井住友信託銀行  
決算データ

三井住友トラスト・ホールディングス  
パーゼル川関連データ

三井住友信託銀行  
パーゼル川関連データ

開示項目一覧

(単位：百万円、%)

| CC1               |     |                                                  |           |           |                            |
|-------------------|-----|--------------------------------------------------|-----------|-----------|----------------------------|
| 国際様式の<br>該当番号     |     | 項 目                                              | イ         | ロ         | ハ                          |
|                   |     |                                                  | 2020年9月末  | 2019年9月末  | 別紙様式<br>第十三号（CC2）の<br>参照項目 |
| その他Tier1資本に係る基礎項目 |     |                                                  |           |           |                            |
| 30                | 31a | その他Tier1資本調達手段に係る株主資本の額                          | —         | —         |                            |
|                   | 31b | その他Tier1資本調達手段に係る新株予約権の額                         | —         | —         |                            |
|                   | 32  | その他Tier1資本調達手段に係る負債の額                            | 340,000   | 340,000   |                            |
|                   |     | 特別目的会社等の発行するその他Tier1資本調達手段の額                     | —         | —         |                            |
| 33+35             |     | 適格旧Tier1資本調達手段の額のうちその他Tier1資本に係る基礎項目の額に含まれる額     | —         | —         |                            |
| 36                |     | その他Tier1資本に係る基礎項目の額（二）                           | 340,000   | 340,000   |                            |
| その他Tier1資本に係る調整項目 |     |                                                  |           |           |                            |
| 37                |     | 自己保有その他Tier1資本調達手段の額                             | —         | —         |                            |
| 38                |     | 意図的に保有している他の金融機関等のその他Tier1資本調達手段の額               | —         | —         |                            |
| 39                |     | 少数出資金融機関等のその他Tier1資本調達手段の額                       | —         | —         |                            |
| 40                |     | その他金融機関等のその他Tier1資本調達手段の額                        | —         | —         |                            |
| 42                |     | Tier2資本不足額                                       | —         | —         |                            |
| 43                |     | その他Tier1資本に係る調整項目の額（ホ）                           | —         | —         |                            |
| その他Tier1資本        |     |                                                  |           |           |                            |
| 44                |     | その他Tier1資本の額（（二）－（ホ））（ヘ）                         | 340,000   | 340,000   |                            |
| Tier1資本           |     |                                                  |           |           |                            |
| 45                |     | Tier1資本の額（（ハ）＋（ヘ））（ト）                            | 2,214,965 | 2,252,687 |                            |
| Tier2資本に係る基礎項目    |     |                                                  |           |           |                            |
| 46                |     | Tier2資本調達手段に係る株主資本の額                             | —         | —         |                            |
|                   |     | Tier2資本調達手段に係る新株予約権の額                            | —         | —         |                            |
|                   |     | Tier2資本調達手段に係る負債の額                               | 341,657   | 309,589   |                            |
|                   |     | 特別目的会社等の発行するTier2資本調達手段の額                        | —         | —         |                            |
| 47＋49             |     | 適格旧Tier2資本調達手段の額のうちTier2資本に係る基礎項目の額に含まれる額        | 170,648   | 209,227   |                            |
| 50                |     | 一般貸倒引当金Tier2算入額及び適格引当金Tier2算入額の合計額               | 10,341    | —         |                            |
| 50a               |     | うち、一般貸倒引当金Tier2算入額                               | —         | —         |                            |
| 50b               |     | うち、適格引当金Tier2算入額                                 | 10,341    | —         |                            |
| 51                |     | Tier2資本に係る基礎項目の額（チ）                              | 522,647   | 518,817   |                            |
| Tier2資本に係る調整項目    |     |                                                  |           |           |                            |
| 52                |     | 自己保有Tier2資本調達手段の額                                | —         | —         |                            |
| 53                |     | 意図的に保有している他の金融機関等のTier2資本調達手段及びその他外部TLAC関連調達手段の額 | —         | —         |                            |
| 54                |     | 少数出資金融機関等のTier2資本調達手段及びその他外部TLAC関連調達手段の額         | —         | —         |                            |
| 55                |     | その他金融機関等のTier2資本調達手段及びその他外部TLAC関連調達手段の額          | 1,540     | 1,540     |                            |
| 57                |     | Tier2資本に係る調整項目の額（リ）                              | 1,540     | 1,540     |                            |
| Tier2資本           |     |                                                  |           |           |                            |
| 58                |     | Tier2資本の額（（チ）－（リ））（ヌ）                            | 521,107   | 517,277   |                            |
| 総自己資本             |     |                                                  |           |           |                            |
| 59                |     | 総自己資本の額（（ト）＋（ヌ））（ル）                              | 2,736,073 | 2,769,965 |                            |

三井住友トラスト・ホールディングス  
決算データ

三井住友信託銀行  
決算データ

三井住友トラスト・ホールディングス  
パーゼラル川関連データ

三井住友信託銀行  
パーゼラル川関連データ

開示項目一覧

(単位：百万円、%)

| CC1                             |                                                                                                              |            |            |                            |
|---------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------|------------|----------------------------|
| 国際様式の<br>該当番号                   | 項 目                                                                                                          | イ          | ロ          | ハ                          |
|                                 |                                                                                                              | 2020年9月末   | 2019年9月末   | 別紙様式<br>第十三号（CC2）の<br>参照項目 |
| リスク・アセット                        |                                                                                                              |            |            |                            |
| 60                              | リスク・アセットの額の合計額<br>(ヲ)                                                                                        | 18,653,915 | 18,149,949 |                            |
| 自己資本比率                          |                                                                                                              |            |            |                            |
| 61                              | 普通株式等Tier1比率（(ハ)/(ヲ)）                                                                                        | 10.05%     | 10.53%     |                            |
| 62                              | Tier1比率（(ト)/(ヲ)）                                                                                             | 11.87%     | 12.41%     |                            |
| 63                              | 総自己資本比率（(ル)/(ヲ)）                                                                                             | 14.66%     | 15.26%     |                            |
| 調整項目に係る参考事項                     |                                                                                                              |            |            |                            |
| 72                              | 少数出資金融機関等の対象資本等調達手段に係る調整項目不<br>算入額                                                                           | 110,614    | 118,515    |                            |
| 73                              | その他金融機関等に係る対象資本等調達手段のうち 普通株式<br>に係る調整項目不算入額                                                                  | 63,025     | 62,938     |                            |
| 74                              | 無形固定資産（モーゲージ・サービシング・ライツに係るも<br>のに限る。）に係る調整項目不算入額                                                             | —          | —          |                            |
| 75                              | 繰延税金資産（一時差異に係るものに限る。）に係る調整項目<br>不算入額                                                                         | —          | —          |                            |
| Tier2資本に係る基礎項目の額に算入される引当金に関する事項 |                                                                                                              |            |            |                            |
| 76                              | 一般貸倒引当金の額                                                                                                    | —          | —          |                            |
| 77                              | 一般貸倒引当金に係るTier2資本算入上限額                                                                                       | 2,329      | 2,036      |                            |
| 78                              | 内部格付手法採用行において、適格引当金の合計額から事業<br>法人等向けエクスポージャー及びリテール向けエクスポー<br>ジャーの期待損失額の合計額を控除した額（当該額が零を下回<br>る場合にあっては、零とする。） | 10,341     | —          |                            |
| 79                              | 適格引当金に係るTier2資本算入上限額                                                                                         | 94,666     | 94,206     |                            |
| 資本調達手段に係る経過措置に関する事項             |                                                                                                              |            |            |                            |
| 82                              | 適格旧Tier1資本調達手段に係る算入上限額                                                                                       | 77,800     | 116,700    |                            |
| 83                              | 適格旧Tier1資本調達手段の額から適格旧Tier1資本調達手段に<br>係る算入上限額を控除した額（当該額が零を下回る場合にあ<br>っては、零とする。）                               | —          | —          |                            |
| 84                              | 適格旧Tier2資本調達手段に係る算入上限額                                                                                       | 171,581    | 257,372    |                            |
| 85                              | 適格旧Tier2資本調達手段の額から適格旧Tier2資本調達手段に<br>係る算入上限額を控除した額（当該額が零を下回る場合にあ<br>っては、零とする。）                               | —          | —          |                            |

(注) 1. 当社は単体自己資本比率の算定に関し、「自己資本比率及びレバレッジ比率の算定に対する合意された手続業務に関する実務指針」(日本公認会計士協会専門業務実務指針4465 令和元年8月27日)に基づく外部監査を有限責任 あずさ監査法人より受けております。  
当該外部監査は財務諸表の監査又は財務報告に係る内部統制の監査の一部ではなく、当社と合意した範囲及び手続により外部監査人が実施し、その結果を当社宛に報告するものであります。外部監査人が単体自己資本比率そのものや単体自己資本比率の算定に係る内部統制について意見又は結論を表明するものではありません。

貸借対照表の科目が自己資本の構成に関する開示項目のいずれに相当するかについての説明

2020年9月末

CC2：貸借対照表の科目と自己資本の構成に関する開示項目の対応関係

(単位：百万円)

| CC2         |             |                             |                            |            |
|-------------|-------------|-----------------------------|----------------------------|------------|
| 項 目         | イ           | ロ                           | ハ                          | ニ          |
|             | 公表<br>貸借対照表 | 規制上の連結範囲<br>に基づく連結貸借<br>対照表 | 別紙様式<br>第一号を参照する<br>番号又は記号 | 付表<br>参照番号 |
| (資産の部)      |             |                             |                            |            |
| 現金預け金       | 17,124,628  | 17,124,629                  |                            |            |
| コールローン      | 21,818      | 21,818                      |                            |            |
| 買現先勘定       | 145,010     | 145,010                     |                            |            |
| 債券貸借取引支払保証金 | 779,616     | 779,616                     |                            |            |
| 買入金銭債権      | 44,516      | 44,516                      |                            |            |
| 特定取引資産      | 554,402     | 554,402                     |                            |            |
| 金銭の信託       | 99          | 99                          |                            |            |
| 有価証券        | 6,922,720   | 6,922,719                   |                            | 6-a        |
| 貸出金         | 30,181,186  | 30,181,186                  |                            | 6-b        |
| 外国為替        | 46,173      | 46,173                      |                            |            |
| その他資産       | 1,290,029   | 1,290,029                   |                            | 6-c        |
| 有形固定資産      | 189,617     | 189,617                     |                            |            |
| 無形固定資産      | 73,108      | 73,108                      |                            | 2          |
| 前払年金費用      | 191,666     | 191,666                     |                            | 3          |
| 支払承諾見返      | 388,064     | 388,064                     |                            |            |
| 貸倒引当金       | △ 96,448    | △ 96,448                    |                            |            |
| 資産の部合計      | 57,856,212  | 57,856,211                  |                            |            |

(単位：百万円)

| CC2          |             |                             |                            |            |
|--------------|-------------|-----------------------------|----------------------------|------------|
| 項 目          | イ           | ロ                           | ハ                          | ニ          |
|              | 公表<br>貸借対照表 | 規制上の連結範囲<br>に基づく連結貸借<br>対照表 | 別紙様式<br>第一号を参照する<br>番号又は記号 | 付表<br>参照番号 |
| (負債の部)       |             |                             |                            |            |
| 預金           | 33,777,147  | 33,777,147                  |                            |            |
| 譲渡性預金        | 7,235,704   | 7,235,704                   |                            |            |
| コールマネー       | 86,327      | 86,327                      |                            |            |
| 売現先勘定        | 1,379,058   | 1,379,058                   |                            |            |
| 特定取引負債       | 325,463     | 325,463                     |                            |            |
| 借入金          | 5,751,859   | 5,751,859                   |                            | 7          |
| 外国為替         | 18,041      | 18,041                      |                            |            |
| 短期社債         | 1,947,194   | 1,947,194                   |                            |            |
| 社債           | 527,082     | 527,082                     |                            |            |
| 信託勘定借        | 3,517,414   | 3,517,414                   |                            |            |
| その他負債        | 745,450     | 745,450                     |                            | 6-d        |
| 賞与引当金        | 8,166       | 8,166                       |                            |            |
| 役員賞与引当金      | —           | —                           |                            |            |
| 株式給付引当金      | 302         | 302                         |                            |            |
| 退職給付引当金      | 759         | 759                         |                            |            |
| 睡眠預金払戻損失引当金  | 4,415       | 4,415                       |                            |            |
| 偶発損失引当金      | 1,455       | 1,455                       |                            |            |
| 繰延税金負債       | 91,443      | 91,443                      |                            | 4-a        |
| 再評価に係る繰延税金負債 | 2,439       | 2,439                       |                            | 4-b        |
| 支払承諾         | 388,064     | 388,064                     |                            |            |
| 負債の部合計       | 55,807,791  | 55,807,791                  |                            |            |
| (純資産の部)      |             |                             |                            |            |
| 資本金          | 342,037     | 342,037                     |                            | 1-a        |
| 資本剰余金        | 343,066     | 343,066                     |                            | 1-b        |
| 利益剰余金        | 1,061,769   | 1,061,769                   |                            | 1-c        |
| 株主資本合計       | 1,746,872   | 1,746,872                   |                            |            |
| その他有価証券評価差額金 | 354,904     | 354,904                     |                            |            |
| 繰延ヘッジ損益      | △ 49,454    | △ 49,454                    |                            | 5          |
| 土地再評価差額金     | △ 3,901     | △ 3,901                     |                            |            |
| 為替換算調整勘定     | —           | △ 0                         |                            |            |
| 評価・換算差額等合計   | 301,548     | 301,548                     | (a)                        |            |
| 純資産の部合計      | 2,048,420   | 2,048,420                   |                            |            |
| 負債及び純資産の部合計  | 57,856,212  | 57,856,211                  |                            |            |

三井住友トラスト・ホールディングス  
決算データ

三井住友信託銀行  
決算データ

三井住友トラスト・ホールディングス  
パーゼル川関連データ

三井住友信託銀行  
パーゼル川関連データ

開示項目一覧

## (付表)

(注) 本表の「自己資本の構成に関する開示項目」の金額については、経過措置により自己資本に算入されている項目については含んでおりません。

### 1. 株主資本

#### (1) 貸借対照表

(単位：百万円)

| 貸借対照表科目 | 金額        | 備考 | 参照番号 |
|---------|-----------|----|------|
| 資本金     | 342,037   |    | 1-a  |
| 資本剰余金   | 343,066   |    | 1-b  |
| 利益剰余金   | 1,061,769 |    | 1-c  |
| 株主資本合計  | 1,746,872 |    |      |

#### (2) 自己資本の構成

(単位：百万円)

| 自己資本の構成に関する開示項目    | 金額        | 備考                            | 国際様式の<br>該当番号 |
|--------------------|-----------|-------------------------------|---------------|
| 普通株式等Tier1資本に係る額   | 1,746,872 | 普通株式に係る株主資本（社外流出<br>予定額調整前）   |               |
| うち、資本金及び資本剰余金の額    | 685,103   |                               | 1a            |
| うち、利益剰余金の額         | 1,061,769 |                               | 2             |
| うち、自己株式の額（△）       | —         |                               | 1c            |
| うち、上記以外に該当するものの額   | —         |                               |               |
| その他Tier1資本調達手段に係る額 | —         | 実質破綻時損失吸収条項のある優<br>先株式に係る株主資本 | 31a           |

### 2. 無形固定資産

#### (1) 貸借対照表

(単位：百万円)

| 貸借対照表科目 | 金額     | 備考 | 参照番号 |
|---------|--------|----|------|
| 無形固定資産  | 73,108 |    | 2    |

#### 上記に係る税効果

|  |        |  |  |
|--|--------|--|--|
|  | 22,385 |  |  |
|--|--------|--|--|

#### (2) 自己資本の構成

(単位：百万円)

| 自己資本の構成に関する開示項目                                | 金額     | 備考                                    | 国際様式の<br>該当番号 |
|------------------------------------------------|--------|---------------------------------------|---------------|
| 無形固定資産 のれんに係るもの                                | —      |                                       | 8             |
| 無形固定資産 その他の無形固定資産                              | 50,722 | のれん、モーゲージ・サービシン<br>グ・ライセンス以外（ソフトウェア等） | 9             |
| 無形固定資産 モーゲージ・サービシング・ライセンス                      | —      |                                       |               |
| 特定項目に係る十パーセント基準超過額                             | —      |                                       | 20            |
| 特定項目に係る十五パーセント基準超過額                            | —      |                                       | 24            |
| 無形固定資産（モーゲージ・サービシング・ライセンスに係るものに限定。）に係る調整項目不算入額 | —      |                                       | 74            |

### 3. 前払年金費用

#### (1) 貸借対照表

(単位：百万円)

| 貸借対照表科目  | 金額      | 備考 | 参照番号 |
|----------|---------|----|------|
| 前払年金費用   | 191,666 |    | 3    |
| 上記に係る税効果 | 58,688  |    |      |

#### (2) 自己資本の構成

(単位：百万円)

| 自己資本の構成に関する開示項目 | 金額      | 備考 | 国際様式の<br>該当番号 |
|-----------------|---------|----|---------------|
| 前払年金費用の額        | 132,978 |    | 15            |

### 4. 繰延税金資産

#### (1) 貸借対照表

(単位：百万円)

| 貸借対照表科目           | 金額     | 備考 | 参照番号 |
|-------------------|--------|----|------|
| 繰延税金負債            | 91,443 |    | 4-a  |
| 再評価に係る繰延税金負債      | 2,439  |    | 4-b  |
| その他の無形固定資産の税効果勘案分 | 22,385 |    |      |
| 前払年金費用の税効果勘案分     | 58,688 |    |      |

#### (2) 自己資本の構成

(単位：百万円)

| 自己資本の構成に関する開示項目                  | 金額 | 備考                         | 国際様式の<br>該当番号 |
|----------------------------------|----|----------------------------|---------------|
| 繰延税金資産（一時差異に係るものを除く。）            | —  | 資産負債相殺処理のため、貸借対照表計上額とは一致せず | 10            |
| 一時差異に係る繰延税金資産                    | —  | 資産負債相殺処理のため、貸借対照表計上額とは一致せず |               |
| 特定項目に係る十パーセント基準超過額               | —  |                            | 21            |
| 特定項目に係る十五パーセント基準超過額              | —  |                            | 25            |
| 繰延税金資産（一時差異に係るものに限る。）に係る調整項目不算入額 | —  |                            | 75            |

### 5. 繰延ヘッジ損益

#### (1) 貸借対照表

(単位：百万円)

| 貸借対照表科目 | 金額       | 備考 | 参照番号 |
|---------|----------|----|------|
| 繰延ヘッジ損益 | △ 49,454 |    | 5    |

#### (2) 自己資本の構成

(単位：百万円)

| 自己資本の構成に関する開示項目 | 金額       | 備考                                            | 国際様式の<br>該当番号 |
|-----------------|----------|-----------------------------------------------|---------------|
| 繰延ヘッジ損益の額       | △ 39,538 | ヘッジ対象に係る時価評価差額が「評価・換算差額等合計」として計上されているものを除いたもの | 11            |

6. 金融機関向け出資等

(1) 貸借対照表

(単位：百万円)

| 貸借対照表科目 | 金額         | 備考         | 参照番号 |
|---------|------------|------------|------|
| 有価証券    | 6,922,720  |            | 6-a  |
| 貸出金     | 30,181,186 | 劣後債務等を含む   | 6-b  |
| その他資産   | 1,290,029  | 金融派生商品等を含む | 6-c  |
| その他負債   | 745,450    | 金融派生商品等を含む | 6-d  |

(2) 自己資本の構成

(単位：百万円)

| 自己資本の構成に関する開示項目                            | 金額      | 備考 | 国際様式の<br>該当番号 |
|--------------------------------------------|---------|----|---------------|
| 自己保有資本調達手段の額                               | —       |    |               |
| 普通株式等Tier1相当額                              | —       |    | 16            |
| その他Tier1相当額                                | —       |    | 37            |
| Tier2相当額                                   | —       |    | 52            |
| 意図的に保有している他の金融機関等の資本等調達手段の額                | —       |    |               |
| 普通株式等Tier1相当額                              | —       |    | 17            |
| その他Tier1相当額                                | —       |    | 38            |
| Tier2相当額およびその他外部TLAC関連相当額                  | —       |    | 53            |
| 少数出資金融機関等の資本等調達手段の額                        | 110,614 |    |               |
| 普通株式等Tier1相当額                              | —       |    | 18            |
| その他Tier1相当額                                | —       |    | 39            |
| Tier2相当額およびその他外部TLAC関連相当額                  | —       |    | 54            |
| 少数出資金融機関等の対象資本等調達手段に係る調整<br>項目不算入額         | 110,614 |    | 72            |
| その他金融機関等（10%超出資）に係る資本等調達手段の額               | 64,565  |    |               |
| 特定項目に係る十パーセント基準超過額                         | —       |    | 19            |
| 特定項目に係る十五パーセント基準超過額                        | —       |    | 23            |
| その他Tier1相当額                                | —       |    | 40            |
| Tier2相当額およびその他外部TLAC関連相当額                  | 1,540   |    | 55            |
| その他金融機関等に係る対象資本等調達手段のうち普通<br>株式に係る調整項目不算入額 | 63,025  |    | 73            |

7. その他資本調達

(1) 貸借対照表

(単位：百万円)

| 貸借対照表科目 | 金額        | 備考 | 参照番号 |
|---------|-----------|----|------|
| 借入金     | 5,751,859 |    | 7    |

(2) 自己資本の構成

(単位：百万円)

| 自己資本の構成に関する開示項目       | 金額      | 備考 | 国際様式の<br>該当番号 |
|-----------------------|---------|----|---------------|
| その他Tier1資本調達手段に係る負債の額 | 340,000 |    | 32            |
| Tier2資本調達手段に係る負債の額    | 341,657 |    | 46            |

2019年9月末

(単位：百万円)

| CC2         |             |                             |                            |            |
|-------------|-------------|-----------------------------|----------------------------|------------|
| 項 目         | イ           | ロ                           | ハ                          | ニ          |
|             | 公表<br>貸借対照表 | 規制上の連結範囲<br>に基づく連結貸借<br>対照表 | 別紙様式<br>第一号を参照する<br>番号又は記号 | 付表<br>参照番号 |
| (資産の部)      |             |                             |                            |            |
| 現金預け金       | 15,929,438  | 15,929,439                  |                            |            |
| コールローン      | 52,764      | 52,764                      |                            |            |
| 買現先勘定       | 159,139     | 159,139                     |                            |            |
| 債券貸借取引支払保証金 | 741,350     | 741,350                     |                            |            |
| 買入金銭債権      | 42,916      | 42,916                      |                            |            |
| 特定取引資産      | 468,135     | 468,135                     |                            |            |
| 金銭の信託       | 99          | 99                          |                            |            |
| 有価証券        | 6,381,176   | 6,381,175                   |                            | 6-a        |
| 貸出金         | 29,280,061  | 29,280,061                  |                            | 6-b        |
| 外国為替        | 32,155      | 32,155                      |                            |            |
| その他資産       | 1,291,018   | 1,291,018                   |                            | 6-c        |
| 有形固定資産      | 192,736     | 192,736                     |                            |            |
| 無形固定資産      | 69,613      | 69,613                      |                            | 2          |
| 前払年金費用      | 179,161     | 179,161                     |                            | 3          |
| 支払承諾見返      | 420,745     | 420,745                     |                            |            |
| 貸倒引当金       | △ 65,434    | △ 65,434                    |                            |            |
| 資産の部合計      | 55,175,077  | 55,175,076                  |                            |            |

三井住友トラスト・ホールディングス  
決算データ

三井住友信託銀行  
決算データ

三井住友トラスト・ホールディングス・パーゼル川関連データ

三井住友信託銀行  
パーゼル川関連データ

開示項目一覧

(単位：百万円)

| CC2          |             |                             |                            |            |
|--------------|-------------|-----------------------------|----------------------------|------------|
| 項 目          | イ           | ロ                           | ハ                          | ニ          |
|              | 公表<br>貸借対照表 | 規制上の連結範囲<br>に基づく連結貸借<br>対照表 | 別紙様式<br>第一号を参照する<br>番号又は記号 | 付表<br>参照番号 |
| (負債の部)       |             |                             |                            |            |
| 預金           | 30,557,568  | 30,557,568                  |                            |            |
| 譲渡性預金        | 7,142,216   | 7,142,216                   |                            |            |
| コールマネー       | 1,911,650   | 1,911,650                   |                            |            |
| 売現先勘定        | 1,636,623   | 1,636,623                   |                            |            |
| 債券貸借取引受入担保金  | 141,156     | 141,156                     |                            |            |
| 特定取引負債       | 304,382     | 304,382                     |                            |            |
| 借入金          | 4,170,320   | 4,170,320                   |                            | 7          |
| 外国為替         | 16,503      | 16,503                      |                            |            |
| 短期社債         | 1,386,776   | 1,386,776                   |                            |            |
| 社債           | 542,681     | 542,681                     |                            |            |
| 信託勘定借        | 3,965,260   | 3,965,260                   |                            |            |
| その他負債        | 692,076     | 692,076                     |                            | 6-d        |
| 賞与引当金        | 8,216       | 8,216                       |                            |            |
| 役員賞与引当金      | —           | —                           |                            |            |
| 株式給付引当金      | 109         | 109                         |                            |            |
| 退職給付引当金      | 731         | 731                         |                            |            |
| 睡眠預金払戻損失引当金  | 4,275       | 4,275                       |                            |            |
| 偶発損失引当金      | 1,385       | 1,385                       |                            |            |
| 繰延税金負債       | 144,290     | 144,290                     |                            | 4-a        |
| 再評価に係る繰延税金負債 | 2,455       | 2,455                       |                            | 4-b        |
| 支払承諾         | 420,745     | 420,745                     |                            |            |
| 負債の部合計       | 53,049,428  | 53,049,428                  |                            |            |
| (純資産の部)      |             |                             |                            |            |
| 資本金          | 342,037     | 342,037                     |                            | 1-a        |
| 資本剰余金        | 343,066     | 343,066                     |                            | 1-b        |
| 利益剰余金        | 1,037,703   | 1,037,703                   |                            | 1-c        |
| 株主資本合計       | 1,722,806   | 1,722,806                   |                            |            |
| その他有価証券評価差額金 | 448,289     | 448,289                     |                            |            |
| 繰延ヘッジ損益      | △ 42,038    | △ 42,038                    |                            | 5          |
| 土地再評価差額金     | △ 3,409     | △ 3,409                     |                            |            |
| 為替換算調整勘定     | —           | △ 0                         |                            |            |
| 評価・換算差額等合計   | 402,842     | 402,842                     | (a)                        |            |
| 純資産の部合計      | 2,125,648   | 2,125,648                   |                            |            |
| 負債及び純資産の部合計  | 55,175,077  | 55,175,076                  |                            |            |

三井住友トラスト・ホールディングス  
決算データ

三井住友信託銀行  
決算データ

三井住友トラスト・ホールディングス  
パーゼル川関連データ

三井住友信託銀行  
パーゼル川関連データ

開示項目一覧

## (付表)

(注) 本表の「自己資本の構成に関する開示項目」の金額については、経過措置により自己資本に算入されている項目については含んでおりません。

### 1. 株主資本

#### (1) 貸借対照表

(単位：百万円)

| 貸借対照表科目 | 金額        | 備考 | 参照番号 |
|---------|-----------|----|------|
| 資本金     | 342,037   |    | 1-a  |
| 資本剰余金   | 343,066   |    | 1-b  |
| 利益剰余金   | 1,037,703 |    | 1-c  |
| 株主資本合計  | 1,722,806 |    |      |

#### (2) 自己資本の構成

(単位：百万円)

| 自己資本の構成に関する開示項目    | 金額        | 備考                            | 国際様式の<br>該当番号 |
|--------------------|-----------|-------------------------------|---------------|
| 普通株式等Tier1資本に係る額   | 1,722,806 | 普通株式に係る株主資本（社外流出<br>予定額調整前）   |               |
| うち、資本金及び資本剰余金の額    | 685,103   |                               | 1a            |
| うち、利益剰余金の額         | 1,037,703 |                               | 2             |
| うち、自己株式の額（△）       | —         |                               | 1c            |
| うち、上記以外に該当するものの額   | —         |                               |               |
| その他Tier1資本調達手段に係る額 | —         | 実質破綻時損失吸収条項のある優<br>先株式に係る株主資本 | 31a           |

### 2. 無形固定資産

#### (1) 貸借対照表

(単位：百万円)

| 貸借対照表科目  | 金額     | 備考 | 参照番号 |
|----------|--------|----|------|
| 無形固定資産   | 69,613 |    | 2    |
| 上記に係る税効果 | 21,315 |    |      |

#### (2) 自己資本の構成

(単位：百万円)

| 自己資本の構成に関する開示項目                                | 金額     | 備考                                    | 国際様式の<br>該当番号 |
|------------------------------------------------|--------|---------------------------------------|---------------|
| 無形固定資産 のれんに係るもの                                | —      |                                       | 8             |
| 無形固定資産 その他の無形固定資産                              | 48,297 | のれん、モーゲージ・サービシン<br>グ・ライセンス以外（ソフトウェア等） | 9             |
| 無形固定資産 モーゲージ・サービシング・ライセンス                      | —      |                                       |               |
| 特定項目に係る十パーセント基準超過額                             | —      |                                       | 20            |
| 特定項目に係る十五パーセント基準超過額                            | —      |                                       | 24            |
| 無形固定資産（モーゲージ・サービシング・ライセンスに係るものに限る。）に係る調整項目不算入額 | —      |                                       | 74            |

3. 前払年金費用

(1) 貸借対照表

(単位：百万円)

| 貸借対照表科目  | 金額      | 備考 | 参照番号 |
|----------|---------|----|------|
| 前払年金費用   | 179,161 |    | 3    |
| 上記に係る税効果 | 54,859  |    |      |

(2) 自己資本の構成

(単位：百万円)

| 自己資本の構成に関する開示項目 | 金額      | 備考 | 国際様式の<br>該当番号 |
|-----------------|---------|----|---------------|
| 前払年金費用の額        | 124,301 |    | 15            |

4. 繰延税金資産

(1) 貸借対照表

(単位：百万円)

| 貸借対照表科目      | 金額      | 備考 | 参照番号 |
|--------------|---------|----|------|
| 繰延税金負債       | 144,290 |    | 4-a  |
| 再評価に係る繰延税金負債 | 2,455   |    | 4-b  |

その他の無形固定資産の税効果勘案分

|               |        |  |  |
|---------------|--------|--|--|
| 前払年金費用の税効果勘案分 | 21,315 |  |  |
|---------------|--------|--|--|

(2) 自己資本の構成

(単位：百万円)

| 自己資本の構成に関する開示項目                  | 金額 | 備考                         | 国際様式の<br>該当番号 |
|----------------------------------|----|----------------------------|---------------|
| 繰延税金資産（一時差異に係るものを除く。）            | —  | 資産負債相殺処理のため、貸借対照表計上額とは一致せず | 10            |
| 一時差異に係る繰延税金資産                    | —  | 資産負債相殺処理のため、貸借対照表計上額とは一致せず |               |
| 特定項目に係る十パーセント基準超過額               | —  |                            | 21            |
| 特定項目に係る十五パーセント基準超過額              | —  |                            | 25            |
| 繰延税金資産（一時差異に係るものに限る。）に係る調整項目不算入額 | —  |                            | 75            |

5. 繰延ヘッジ損益

(1) 貸借対照表

(単位：百万円)

| 貸借対照表科目 | 金額       | 備考 | 参照番号 |
|---------|----------|----|------|
| 繰延ヘッジ損益 | △ 42,038 |    | 5    |

(2) 自己資本の構成

(単位：百万円)

| 自己資本の構成に関する開示項目 | 金額       | 備考                                            | 国際様式の<br>該当番号 |
|-----------------|----------|-----------------------------------------------|---------------|
| 繰延ヘッジ損益の額       | △ 34,585 | ヘッジ対象に係る時価評価差額が「評価・換算差額等合計」として計上されているものを除いたもの | 11            |

6. 金融機関向け出資等

(1) 貸借対照表

(単位：百万円)

| 貸借対照表科目 | 金額         | 備考         | 参照番号 |
|---------|------------|------------|------|
| 有価証券    | 6,381,176  |            | 6-a  |
| 貸出金     | 29,280,061 | 劣後債務等を含む   | 6-b  |
| その他資産   | 1,291,018  | 金融派生商品等を含む | 6-c  |
| その他負債   | 692,076    | 金融派生商品等を含む | 6-d  |

(2) 自己資本の構成

(単位：百万円)

| 自己資本の構成に関する開示項目                            | 金額      | 備考 | 国際様式の<br>該当番号 |
|--------------------------------------------|---------|----|---------------|
| 自己保有資本調達手段の額                               | —       |    |               |
| 普通株式等Tier1相当額                              | —       |    | 16            |
| その他Tier1相当額                                | —       |    | 37            |
| Tier2相当額                                   | —       |    | 52            |
| 意図的に保有している他の金融機関等の資本等調達手段の額                | —       |    |               |
| 普通株式等Tier1相当額                              | —       |    | 17            |
| その他Tier1相当額                                | —       |    | 38            |
| Tier2相当額およびその他外部TLAC関連相当額                  | —       |    | 53            |
| 少数出資金融機関等の資本等調達手段の額                        | 118,515 |    |               |
| 普通株式等Tier1相当額                              | —       |    | 18            |
| その他Tier1相当額                                | —       |    | 39            |
| Tier2相当額およびその他外部TLAC関連相当額                  | —       |    | 54            |
| 少数出資金融機関等の対象資本等調達手段に係る調整<br>項目不算入額         | 118,515 |    | 72            |
| その他金融機関等（10%超出資）に係る資本等調達手段の額               | 64,478  |    |               |
| 特定項目に係る十パーセント基準超過額                         | —       |    | 19            |
| 特定項目に係る十五パーセント基準超過額                        | —       |    | 23            |
| その他Tier1相当額                                | —       |    | 40            |
| Tier2相当額およびその他外部TLAC関連相当額                  | 1,540   |    | 55            |
| その他金融機関等に係る対象資本等調達手段のうち普通<br>株式に係る調整項目不算入額 | 62,938  |    | 73            |

7. その他資本調達

(1) 貸借対照表

(単位：百万円)

| 貸借対照表科目 | 金額        | 備考 | 参照番号 |
|---------|-----------|----|------|
| 借入金     | 4,170,320 |    | 7    |

(2) 自己資本の構成

(単位：百万円)

| 自己資本の構成に関する開示項目       | 金額      | 備考 | 国際様式の<br>該当番号 |
|-----------------------|---------|----|---------------|
| その他Tier1資本調達手段に係る負債の額 | 340,000 |    | 32            |
| Tier2資本調達手段に係る負債の額    | 309,589 |    | 46            |

三井住友トラスト・  
ホールディングス  
決算データ

三井住友信託銀行  
決算データ

三井住友トラスト・  
ホールディングス  
パーゼル川関連データ

三井住友信託銀行  
パーゼル川関連データ

開示項目一覧



## IRRBB1：金利リスク

(単位：百万円)

| IRRBB1 |            |           |          |           |          |
|--------|------------|-----------|----------|-----------|----------|
| 項番     |            | イ         | ロ        | ハ         | ニ        |
|        |            | ΔEVE      |          | ΔNII      |          |
|        |            | 2020年9月末  | 2019年9月末 | 2020年9月末  | 2019年9月末 |
| 1      | 上方パラレルシフト  | 71,743    | 111,435  | △ 79,389  | △ 59,506 |
| 2      | 下方パラレルシフト  | 30,318    | 37,861   | 75,963    | 60,966   |
| 3      | スティープ化     | 111,960   | 77,588   |           |          |
| 4      | フラット化      | 1,773     | —        |           |          |
| 5      | 短期金利上昇     | —         | 3,159    |           |          |
| 6      | 短期金利低下     | 51,428    | 23,330   |           |          |
| 7      | 最大値        | 111,960   | 111,435  | 75,963    | 60,966   |
|        |            | ホ         |          | ヘ         |          |
|        |            | 2020年9月末  |          | 2019年9月末  |          |
|        |            |           |          |           |          |
| 8      | Tier1 資本の額 | 2,214,965 |          | 2,252,687 |          |

三井住友トラスト・ホールディングス  
決算データ

三井住友信託銀行  
決算データ

三井住友トラスト・ホールディングス  
バーゼルIII関連データ

三井住友信託銀行  
バーゼルIII関連データ

開示項目一覧

# 単体レバレッジ比率に関する開示事項 単体レバレッジ比率の構成に関する事項

(単位：百万円、%)

| 国際様式<br>(表2)の<br>該当番号        | 国際様式<br>(表1)の<br>該当番号 | 項目                                                  | 2020年9月末   | 2019年9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                                 | 40,096,109 | 52,754,211 |
| 1a                           | 1                     | 貸借対照表における総資産の額                                      | 42,598,656 | 55,175,076 |
| 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 (△)                | 2,502,547  | 2,420,865  |
| 2                            | 7                     | Tier1資本に係る調整項目の額 (△)                                | 183,700    | 188,952    |
| 3                            |                       | オン・バランス資産の額 (イ)                                     | 39,912,408 | 52,565,258 |
| 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                               | 534,753    | 474,758    |
| 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                                 | 934,748    | 932,082    |
|                              |                       | 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                      | 516,924    | 425,309    |
| 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 (△)        | 190,551    | 86,781     |
| 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            | 65,600     | 77,339     |
| 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 (△) | 63,600     | 57,300     |
| 11                           | 4                     | デリバティブ取引等に関する額 (ロ)                                  | 1,797,875  | 1,765,409  |
| レポ取引等に関する額                   |                       |                                                     |            |            |
| 12                           |                       | レポ取引等に関する資産の額                                       | 924,627    | 900,489    |
| 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                   | 290,995    | 297,222    |
| 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)                                      | 1,215,622  | 1,197,711  |
| 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                                    | 5,707,577  | 4,942,144  |
| 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 (△)                  | 2,828,388  | 2,354,823  |
| 19                           | 6                     | オフ・バランス取引に関する額 (ニ)                                  | 2,879,188  | 2,587,320  |
| 単体レバレッジ比率                    |                       |                                                     |            |            |
| 20                           |                       | 資本の額 (ホ)                                            | 2,214,965  | 2,252,687  |
| 21                           | 8                     | 総エクスポージャーの額 ((イ) + (ロ) + (ハ) + (ニ)) (ヘ)             | 45,805,095 | 58,115,701 |
| 22                           |                       | 単体レバレッジ比率 ((ホ) / (ヘ))                               | 4.83%      | 3.87%      |
| 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)                                     | 45,805,095 |            |
|                              |                       | 日本銀行に対する預け金の額                                       | 15,257,555 |            |
|                              |                       | 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')                 | 61,062,650 |            |
|                              |                       | 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'))           | 3.62%      |            |

(注) 1. 当社は単体レバレッジ比率の算定に関し、「自己資本比率及びレバレッジ比率の算定に対する合意された手続業務に関する実務指針」(日本公認会計士協会専門業務実務指針4465 令和元年8月27日)に基づく外部監査を有限責任 あずさ監査法人より受けております。  
当該外部監査は財務諸表の監査又は財務報告に係る内部統制の監査の一部ではなく、当社と合意した範囲及び手続により外部監査人が実施し、その結果を当社宛に報告するものであります。外部監査人が単体レバレッジ比率そのものや単体レバレッジ比率の算定に係る内部統制について意見又は結論を表明するものではありません。

## 前中間会計期間の単体レバレッジ比率との間に著しい差異が生じた原因

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であります。

## 単体流動性カバレッジ比率に関する開示事項

## 単体流動性カバレッジ比率に関する定量的開示事項

(単位：百万円、%、件)

| 項 目             |                                                | 2020年度第2四半期  |              | 2020年度第1四半期  |              |
|-----------------|------------------------------------------------|--------------|--------------|--------------|--------------|
| 適格流動資産（１）       |                                                |              |              |              |              |
| 1               | 適格流動資産の合計額                                     | 17,661,017   |              | 13,401,434   |              |
| 資金流出額（２）        |                                                | 資金流出率を乗じる前の額 | 資金流出率を乗じた後の額 | 資金流出率を乗じる前の額 | 資金流出率を乗じた後の額 |
| 2               | リテール無担保資金調達に係る資金流出額                            | 18,037,282   | 857,107      | 17,942,489   | 841,885      |
| 3               | うち、安定預金の額                                      | 769,901      | 23,097       | 735,409      | 22,062       |
| 4               | うち、準安定預金の額                                     | 8,301,228    | 834,010      | 8,157,797    | 819,823      |
| 5               | ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額                          | 12,963,803   | 10,136,607   | 12,433,295   | 10,128,872   |
| 6               | うち、適格オペレーショナル預金の額                              | —            | —            | —            | —            |
| 7               | うち、適格オペレーショナル預金、負債性有価証券以外のホールセール無担保資金調達に係る資金の額 | 10,719,883   | 7,892,687    | 10,365,961   | 8,061,538    |
| 8               | うち、負債性有価証券の額                                   | 2,243,920    | 2,243,920    | 2,067,334    | 2,067,334    |
| 9               | 有担保資金調達等に係る資金流出額                               |              | 56,526       |              | 108,950      |
| 10              | デリバティブ取引等、資金調達プログラム、与信・流動性ファシリティに係る資金流出額       | 5,502,894    | 1,613,581    | 4,953,398    | 1,568,748    |
| 11              | うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額                           | 293,449      | 293,449      | 302,502      | 302,502      |
| 12              | うち、資金調達プログラムに係る資金流出額                           | —            | —            | —            | —            |
| 13              | うち、与信・流動性ファシリティに係る資金流出額                        | 5,209,445    | 1,320,132    | 4,650,896    | 1,266,246    |
| 14              | 資金提供義務等に基づく資金流出額                               | 286,408      | 165,602      | 351,833      | 186,194      |
| 15              | 偶発事象に係る資金流出額                                   | 13,107,681   | 22,690       | 12,308,560   | 23,801       |
| 16              | 資金流出合計額                                        |              | 12,852,113   |              | 12,858,450   |
| 資金流入額（３）        |                                                | 資金流入率を乗じる前の額 | 資金流入率を乗じた後の額 | 資金流入率を乗じる前の額 | 資金流入率を乗じた後の額 |
| 17              | 有担保資金運用等に係る資金流入額                               | 76,808       | —            | 473,934      | 6,377        |
| 18              | 貸付金等の回収に係る資金流入額                                | 3,297,919    | 2,476,146    | 3,131,260    | 2,337,371    |
| 19              | その他資金流入額                                       | 370,563      | 236,131      | 513,209      | 211,231      |
| 20              | 資金流入合計額                                        | 3,745,290    | 2,712,277    | 4,118,403    | 2,554,979    |
| 単体流動性カバレッジ比率（４） |                                                |              |              |              |              |
| 21              | 算入可能適格流動資産の合計額                                 |              | 17,661,017   |              | 13,401,434   |
| 22              | 純資金流出額                                         |              | 10,139,836   |              | 10,303,471   |
| 23              | 単体流動性カバレッジ比率                                   |              | 174.1        |              | 130.0        |
| 24              | 平均値計算用データ数                                     |              | 61           |              | 61           |

## 単体流動性カバレッジ比率に関する定性的開示事項

- 時系列における単体流動性カバレッジ比率の変動に関する事項  
当社における過去2年間の流動性カバレッジ比率は、概ね安定的に推移しております。
- 単体流動性カバレッジ比率の水準の評価に関する事項  
当社単体の流動性カバレッジ比率は、流動性比率規制で定められる規制水準（100%）を満たしており、実績値は当初の見通しと大きく異なっておりません。また、今後の流動性カバレッジ比率の見直しは、現在の水準から大きく離れることは想定しておりません。
- 算入可能適格流動資産の合計額の内容に関する事項  
算入可能適格流動資産は中央銀行への預け金、国債等が大半を占めております。通貨または種類等の構成や所在地に著しい変動は発生しておりません。また、主要な通貨において、算入可能適格流動資産の合計額と純資金流出額の間に著しい通貨のミスマッチは発生しておりません。
- その他単体流動性カバレッジ比率に関する事項  
当社は、「適格オペレーショナル預金に係る特例」および「シナリオ法による時価変動時所要追加担保額」を適用しておりません。