

開示項目一覧

[銀行法施行規則第34条の26に定められた記載事項]

(以下のページに掲載しています)

	三井住友トラスト・ホールディングス
■銀行持株会社の概況及び組織に関する次に掲げる事項	
1. 経営の組織（銀行持株会社の子会社等の経営管理に係る体制を含む。）	本編84～90、3
2. 資本金及び発行済株式の総数	本編118、75
3. 持株数の多い順に10以上の株主に関する次に掲げる事項	
（1）氏名（株主が法人その他の団体である場合には、その名称）	75
（2）各株主の持株数	75
（3）発行済株式の総数に占める各株主の持株数の割合	75
4. 取締役及び監査役の氏名及び役職名	本編91～92
5. 会計監査人の氏名又は名称	17
■銀行持株会社及びその子会社等の概況に関する次に掲げる事項	
1. 銀行持株会社及びその子会社等の主要な事業の内容及び組織の構成	本編58～65、本編118、3、6～7
2. 銀行持株会社の子会社等に関する次に掲げる事項	
（1）名称	3
（2）主たる営業所又は事務所の所在地	3
（3）資本金又は出資金	3
（4）事業の内容	3
（5）設立年月日	3
（6）銀行持株会社が保有する子会社等の議決権の総株主又は総出資者の議決権に占める割合	3
（7）銀行持株会社の一の子会社等以外の子会社等が保有する当該一の子会社等の議決権の総株主又は総出資者の議決権に占める割合	3
■銀行持株会社及びその子会社等の主要な業務に関する事項として次に掲げるもの	
1. 直近の事業年度における事業の概況	本編58～65、本編116～117、16、66
2. 直近の5連結会計年度における主要な業務の状況を示す指標として次に掲げる事項	
（1）経常収益	16
（2）経常利益又は経常損失	16
（3）親会社株主に帰属する当期純利益又は親会社株主に帰属する当期純損失	16
（4）包括利益	16
（5）純資産額	16
（6）総資産額	16
（7）連結自己資本比率	16
■銀行持株会社及びその子会社等の直近の2連結会計年度における財産の状況に関する次に掲げる事項	
1. 連結貸借対照表、連結損益計算書及び連結株主資本等変動計算書	17～20
2. 銀行持株会社及びその子会社等の有する債権のうち次に掲げるものの額及び（1）から（4）までに掲げるものの合計額	
（1）破産更生債権及びこれらに準ずる債権	65
（2）危険債権	65
（3）三月以上延滞債権	65
（4）貸出条件緩和債権	65
（5）正常債権	65
3. 自己資本の充実の状況について金融庁長官が別に定める事項	164～192、194～267
4. 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（3.に掲げる事項を除く。）	183、268～271
5. 連結財務諸表規則第15条の2第1項に規定するセグメント情報	56
6. 連結貸借対照表及び連結損益計算書について会社法第396条第1項による会計監査人の監査を受けている場合にはその旨	17
7. 銀行持株会社が連結貸借対照表、連結損益計算書及び連結株主資本等変動計算書について金融商品取引法第193条の2の規定に基づき公認会計士又は監査法人の監査証明を受けている場合にはその旨	17
8. 連結自己資本比率及び連結レバレッジ比率の算定に関する外部監査を受けている場合にはその旨	198、266、267
■報酬等に関する開示事項	273～276

[銀行法施行規則第19条の2に定められた記載事項（単体ベース）]

	三井住友信託銀行
■銀行の概況及び組織に関する次に掲げる事項	
1. 経営の組織	6～7
2. 持株数の多い順に10以上の株主に関する次に掲げる事項	
（1）氏名（株主が法人その他の団体である場合には、その名称）	162
（2）各株主の持株数	162
（3）発行済株式の総数に占める各株主の持株数の割合	162
3. 取締役及び監査役の氏名及び役職名	4
4. 会計監査人の氏名又は名称	114
5. 営業所の名称及び所在地	8～11
6. 当該銀行を所属銀行とする銀行代理業者に関する次に掲げる事項	
（1）当該銀行代理業者の商号、名称又は氏名	12
（2）当該銀行代理業者が当該銀行のために銀行代理業を営む営業所又は事務所の名称	12
■銀行の主要な業務の内容（信託業務の内容を含む）	本編58～65
■銀行の主要な業務に関する事項として次に掲げるもの	
1. 直近の事業年度における事業の概況	本編58～65、本編116～117、 113
2. 直近の5事業年度における主要な業務の状況を示す指標として次に掲げる事項	
（1）経常収益	113
（2）経常利益又は経常損失	113
（3）当期純利益又は当期純損失	113
（4）資本金及び発行済株式の総数	113
（5）純資産額	113
（6）総資産額	113
（7）預金残高	113
（8）貸出金残高	113
（9）有価証券残高	113
（10）単体自己資本比率	113
（11）配当性向	113
（12）従業員数	113
（13）信託報酬	113
（14）信託勘定貸出金残高	113
（15）信託勘定有価証券残高（（18）に掲げる事項を除く。）	113
（16）信託勘定電子決済手段残高及び履行保証電子決済手段（金融機関の信託業務の兼営等に関する法律施行規則第二十一条第四項に規定する履行保証電子決済手段をいう。）残高	113
（17）信託勘定暗号資産（資金決済に関する法律第2条第14項に規定する暗号資産をいう。）残高及び履行保証暗号資産（金融機関の信託業務の兼営等に関する法律施行規則第21条第5項に規定する履行保証暗号資産をいう。）残高	113
（18）信託勘定電子記録移転有価証券表示権利等（金融商品取引業等に関する内閣府令第1条第四項第17号に規定する電子記録移転有価証券表示権利等をいう。）残高	113
（19）信託財産額	113
3. 直近の2事業年度における業務の状況を示す指標として次に掲げる事項	
[主要な業務の状況を示す指標]	
（1）業務粗利益、業務粗利益率、業務純益、実質業務純益、コア業務純益及びコア業務純益（投資信託解約損益を除く。）	138
（2）国内業務部門並びに国際業務部門の区分ごとの資金運用収支、役務取引等収支、特定取引収支及びその他業務収支	138
（3）国内業務部門並びに国際業務部門の区分ごとの資金運用勘定並びに資金調達勘定の平均残高、利息、利回り及び資金利ざや	139～140
（4）国内業務部門並びに国際業務部門の区分ごとの受取利息及び支払利息の増減	141
（5）総資産経常利益率及び資本経常利益率	143
（6）総資産当期純利益率及び資本当期純利益率	143
[預金に関する指標]	
（1）国内業務部門及び国際業務部門の区分ごとの流動性預金、定期性預金、譲渡性預金その他の預金の平均残高	144
（2）固定金利定期預金、変動金利定期預金及びその他の区分ごとの定期預金の残存期間別の残高	145
[貸出金等に関する指標]	
（1）国内業務部門並びに国際業務部門の区分ごとの手形貸付、証書貸付、当座貸越及び割引手形の平均残高	146
（2）固定金利及び変動金利の区分ごとの貸出金の残存期間別の残高	146
（3）担保の種類別の貸出金残高及び支払承諾見返額	148
（4）使途別の貸出金残高	147
（5）業種別の貸出金残高及び貸出金の総額に占める割合	147
（6）中小企業等に対する貸出金残高及び貸出金の総額に占める割合	147
（7）特定海外債権残高の5%以上を占める国別の残高	148
（8）国内業務部門並びに国際業務部門の区分ごとの預貸率の期末値及び期中平均値	148
[有価証券に関する指標]	
（1）商品有価証券の種類別の平均残高	149
（2）有価証券の種類別の残存期間別の残高	150
（3）国内業務部門及び国際業務部門の区分ごとの有価証券の種類別の平均残高	149
（4）国内業務部門並びに国際業務部門の区分ごとの預証率の期末値及び期中平均値	150

	三井住友信託銀行
【信託業務に関する指標】	
(1) 信託財産残高表	152～153
(2) 金銭信託、年金信託、財産形成給付信託及び貸付信託（以下「金銭信託等」という。）の期末受託残高	154
(3) 元本補てん契約のある信託の種類別の期末受託残高	153
(4) 信託期間別の金銭信託及び貸付信託の元本残高	154
(5) 金銭信託等の種類別の貸出金、有価証券、電子決済手段及び暗号資産の区分ごとの期末運用残高	154
(6) 金銭信託等に係る貸出金の科目別の期末残高	154
(7) 金銭信託等に係る貸出金の契約期間別の期末残高	155
(8) 担保の種類別の金銭信託等に係る貸出金残高	156
(9) 使途別の金銭信託等に係る貸出金残高	156
(10) 業種別の金銭信託等に係る貸出金残高及び貸出金の総額に占める割合	155
(11) 中小企業等に対する金銭信託等に係る貸出金残高及び貸出金の総額に占める割合	155
(12) 金銭信託等に係る有価証券の種類別の期末残高	156
(13) 電子決済手段の種類別の残高	156
(14) 暗号資産の種類別の残高	156
■銀行の業務の運営に関する次に掲げる事項	
1. リスク管理の体制	本編100～104
2. 法令遵守の体制	本編108～109
3. 中小企業の経営の改善及び地域の活性化のための取組の状況	本編105
4. 指定銀行業務紛争解決機関の商号又は名称	398
■銀行の直近の2事業年度における財産の状況に関する次に掲げる事項	
1. 貸借対照表、損益計算書及び株主資本等変動計算書	114～119
2. 銀行の有する債権のうち次に掲げるものの額及び（1）から（4）までに掲げるものの合計額	
（1）破産更生債権及びこれらに準ずる債権	160
（2）危険債権	160
（3）三月以上延滞債権	160
（4）貸出条件緩和債権	160
（5）正常債権	160
3. 元本補てん契約のある信託に係る債権のうち破産更生債権及びこれらに準ずる債権、危険債権、三月以上延滞債権並びに貸出条件緩和債権に該当するものの額並びにこれらの合計額並びに正常債権に該当するものの額	160
4. 自己資本の充実の状況について金融庁長官が別に定める事項	164～192、354～370
5. 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（4.に掲げる事項を除く。）	183、371～377
6. 次に掲げるものに関する取得価額または契約価額、時価及び評価損益	
（1）有価証券	125～129
（2）金銭の信託	130
（3）第13条の3第1項第5号イからホまでに掲げる取引（デリバティブ取引の状況）	131～137
（4）電子決済手段	137
（5）暗号資産	137
7. 貸倒引当金の期末残高及び期中の増減額	159
8. 貸出金償却の額	159
9. 貸借対照表及び損益計算書について会社法第396条第1項による会計監査人の監査を受けている場合にはその旨	114
10. 銀行が貸借対照表、損益計算書及び株主資本等変動計算書について金融商品取引法第193条の2の規定に基づき公認会計士又は監査法人の監査証明を受けている場合にはその旨	114
11. 単体自己資本比率及び単体レバレッジ比率の算定に関する外部監査を受けている場合にはその旨	357、372、373
■報酬等に関する開示事項	379～382

[銀行法施行規則第19条の3に定められた記載事項（連結ベース）]

	三井住友信託銀行
■銀行及びその子会社等の概況に関する次に掲げる事項	
1. 銀行及びその子会社等の主要な事業の内容及び組織の構成	本編58～65、 6～7、13～14
2. 銀行の子会社等に関する次に掲げる事項	
(1) 名称	13～14
(2) 主たる営業所又は事務所の所在地	13～14
(3) 資本金又は出資金	13～14
(4) 事業の内容	13～14
(5) 設立年月日	13～14
(6) 銀行が保有する子会社等の議決権の総株主又は総出資者の議決権に占める割合	13～14
(7) 銀行の一の子会社等以外の子会社等が保有する当該一の子会社等の議決権の総株主、総社員又は総出資者の議決権に占める割合	13～14
■銀行及びその子会社等の主要な業務に関する事項として次に掲げるもの	
1. 直近の事業年度における事業の概況	本編58～65、本編116～117、 77
2. 直近の5連結会計年度における主要な業務の状況を示す指標として次に掲げる事項	
(1) 経常収益	77
(2) 経常利益又は経常損失	77
(3) 親会社株主に帰属する当期純利益又は親会社株主に帰属する当期純損失	77
(4) 包括利益	77
(5) 純資産額	77
(6) 総資産額	77
(7) 連結自己資本比率	77
■銀行及びその子会社等の直近の2連結会計年度における財産の状況に関する次に掲げる事項	
1. 連結貸借対照表、連結損益計算書及び連結株主資本等変動計算書	78～81
2. 銀行及びその子会社等の有する債権のうち次に掲げるものの額及び（1）から（4）までに掲げるものの合計額	
(1) 破産更生債権及びこれらに準ずる債権	112
(2) 危険債権	112
(3) 三月以上延滞債権	112
(4) 貸出条件緩和債権	112
(5) 正常債権	112
3. 自己資本の充実の状況について金融庁長官が別に定める事項	164～192、278～349
4. 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（3.に掲げる事項を除く。）	183、350～353
5. 連結財務諸表規則第15条の2第1項に規定するセグメント情報	110～111
6. 連結貸借対照表及び連結損益計算書について会社法第396条第1項による会計監査人の監査を受けている場合にはその旨	78
7. 銀行が連結貸借対照表、連結損益計算書及び連結株主資本等変動計算書について金融商品取引法第193条の2の規定に基づき公認会計士又は監査法人の監査証明を受けている場合にはその旨	78
8. 連結自己資本比率及び連結レバレッジ比率の算定に関する外部監査を受けている場合にはその旨	282、348、349
■報酬等に関する開示事項	379～382

[金融機能の再生のための緊急措置に関する法律施行規則第4条に定められた記載事項]

	三井住友信託銀行
■破産更生債権及びこれらに準ずる債権	112、160
■危険債権	112、160
■要管理債権	112、160
■正常債権	112、160

[信託業法施行規則第43条第3項に定められた記載事項（単体ベース）]

	三井住友信託銀行
■法第50条の2第1項の登録を受けた者の概況及び組織に関する次に掲げる事項	
1. 商号	3
2. 沿革及び経営の組織	3、6～7
3. 役員及び業務を執行する社員の氏名及び役職名	4
4. 信託法第3条第3号に掲げる方法によってする信託に係る事務を行う主たる営業所並びにその他の営業所の名称及び所在地	161
5. 営んでいる業務の種類	本編58～65
■法第50条の2第1項の登録を受けた者の業務の状況に関する次に掲げる事項	
1. 直近の事業年度における信託法第3条第3号に掲げる方法によってする信託に係る事務の概要	161
2. 直近の5事業年度における信託法第3条第3号に掲げる方法によってする信託に係る事務の状況を示す指標として次に掲げる事項	
(1) 信託報酬	161
(2) 信託財産額	161
(3) 信託財産の概要	161
3. 直近の2事業年度における信託財産の状況を示す指標として次に掲げる事項	
(1) 信託財産残高表	161
(2) 信託財産額の種類ごとの件数、元本額	161
4. 信託財産の分別管理の状況	161
5. 信託法第3条第3号に掲げる方法によってする信託に係る事務以外の業務の状況	本編116～117
■法第50条の2第1項の登録を受けた者の直近の3事業年度における財産の状況に関する事項として次に掲げる事項	
1. 貸借対照表、損益計算書及び株主資本等変動計算書又は社員資本等変動計算書	114～119
2. 1.に掲げる書類について公認会計士又は監査法人の監査を受けている場合にはその旨	114
■法第50条の2第1項の登録を受けた者の内部管理の状況に関する事項	本編84～90
■子会社等を有する場合にあっては、法第50条の2第1項の登録を受けた者及びその子会社等の直近の3事業年度における財産の状況に関する事項として次に掲げる事項	
1. 法第50条の2第1項の登録を受けた者及びその子会社等の連結貸借対照表、連結損益計算書及び連結株主資本等変動計算書	78～81
2. 1.に掲げる書類について公認会計士又は監査法人の監査を受けている場合にはその旨	78
■法第50条の2第1項の登録を受けた者を連結子会社とする者（当該者を連結子会社とする者を除く。）がいる場合にあっては、当該者及び同項の登録を受けた者の直近の3事業年度における財産の状況に関する事項として次に掲げる事項	
1. 当該者及び法第50条の2第1項の登録を受けた者の連結貸借対照表、連結損益計算書及び連結株主資本等変動計算書	17～20
2. 1.に掲げる書類について公認会計士又は監査法人の監査を受けている場合にはその旨	17
■指定紛争解決機関が存在する場合 法第50条の2第1項の登録を受けた者が法第23条の2第1項第1号に定める手続実施基本契約を締結する措置を講ずる当該手続実施基本契約の相手方である指定紛争解決機関の商号又は名称	398

コーポレートデータ

三井住友トラスト・ホールディングス財務関連データ

三井住友信託銀行財務関連データ

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

[平成26年金融庁告示第7号第7条に定められた記載事項]

(以下のページに掲載しています)

	三井住友トラスト・ホールディングス
■自己資本の構成に関する開示事項（別紙様式第5号 CC1）	196～198
■定性的な開示事項	
1. 連結の範囲に関する次に掲げる事項	
(1) 持株自己資本比率告示第3条の規定により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「持株会社グループ」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及び当該相違点の生じた原因	195
(2) 持株会社グループのうち、連結子会社の数並びに主要な連結子会社の名称及び主要な業務の内容	195
(3) 持株自己資本比率告示第9条の規定が適用される金融業務を営む関連法人等の数、名称、貸借対照表の総資産の額及び純資産の額並びに主要な業務の内容	195
(4) 持株会社グループに属する会社であって会計連結範囲に含まれないもの及び持株会社グループに属しない会社であって会計連結範囲に含まれるものの名称、貸借対照表の総資産の額及び純資産の額並びに主要な業務の内容	195
(5) 持株会社グループ内の資金及び自己資本の移動に係る制限等の概要	195
2. 持株会社グループの自己資本の充実度に関する評価方法の概要	168
3. 持株会社グループ（持株自己資本比率告示第3条の規定により連結自己資本比率を算出する対象となる会社の集団をいう。）全体のリスクの特性並びにリスク管理の方針、手続及び体制の概要	164～170
4. 信用リスク（派生商品取引及びレボ形式の取引等における取引の相手方に対する信用リスク並びに証券化取引に係るリスク及びCVAリスクを除く。）に関する次に掲げる事項	
(1) リスクの特性並びにリスク管理の方針、手続及び体制の概要	170～173
(2) 会計上の引当て及び償却に関する基準の概要	23、171、210
(3) 標準的手法採用行にあっては、エクスポージャーの種類ごとのリスク・ウェイトの判定に使用する適格格付機関等（適格格付機関、経済協力開発機構及び輸出信用機関をいう。）の名称（使用する適格格付機関等を変更した場合にあっては、その理由を含む。）	176
(4) 内部格付手法採用行にあっては、次に掲げる事項	
①信用リスク・アセットの額を算出する手法の種類ごとの資産区分別のEAD（標準的手法が適用されるポートフォリオにあっては、エクスポージャーの額。）がEADの総額に占める割合	178
②内部格付手法の適用範囲の決定に係る経緯	174、238
③内部格付制度の概要及び当該制度に関する次に掲げる事項の概要	
ア、資産区分ごとの格付付与手続	174～175
イ、パラメータ推計（PD、LGD及びEADの推計をいう。）及びその検証体制	173～174、177、179
ウ、内部格付制度並びに使用するモデルの開発及び管理等に係る運営体制	173～174、187
④標準的手法が適用されるエクスポージャー（別紙様式第2号第38面により作成するものに係るエクスポージャーに限る。）について、次に掲げる内部格付手法のポートフォリオに分類する場合の基準	
ア、ソブリン向けエクスポージャー	176
イ、金融機関等向けエクスポージャー	176
ウ、株式等エクスポージャー	176
エ、購入債権	176
オ、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。）	176
カ、中堅中小企業向けエクスポージャー	176
キ、居住用不動産向けエクスポージャー	176
ク、適格リボルビング型リテール向けエクスポージャー	176
ケ、その他リテール向けエクスポージャー	176
コ、特定貸付債権	176
サ、事業用不動産向け貸付け及びボラティリティの高い事業用不動産向け貸付け	176
⑤内部格付手法を段階的に適用する計画の有無に応じた所定の事項	174、176
5. 信用リスク削減手法（派生商品取引、レボ形式の取引、信用取引、有価証券の貸付け、現金又は有価証券による担保の提供、長期決済期間取引その他これらに類する取引（以下「派生商品取引及びレボ形式の取引等」という。）に関連して用いられる信用リスク削減手法を除く。）に関するリスクの特性並びにリスク管理の方針、手続及び体制の概要	187～188
6. 派生商品取引及びレボ形式の取引等における取引の相手方に対する信用リスク（以下「カウンターパーティ信用リスク」という。）に関するリスクの特性並びにリスク管理の方針、手続及び体制の概要（当該カウンターパーティ信用リスクの削減手法に関するものを含む。）	188～189
7. 証券化取引に係るリスクに関する次に掲げる事項	
(1) リスクの特性並びにリスク管理の方針、手続及び体制の概要	189～190
(2) 持株自己資本比率告示第226条第1項第1号から第4号まで（持株自己資本比率告示第280条の2第2項において準用する場合を含む。）に規定する体制の整備及びその運用状況の概要	191
(3) 証券化目的導管体を用いて第三者の資産に係る証券化取引を行った場合には、当該証券化目的導管体の名称及び当該証券化取引に係る証券化エクスポージャーを保有しているかどうかの別並びに持株会社グループの子法人等（連結子法人等を除く。）及び関連法人等のうち、当該持株会社グループが行った証券化取引（当該持株会社グループが証券化目的導管体を用いて行った証券化取引を含む。）に係る証券化エクスポージャーを保有し、かつ、当該持株会社グループがその経営に関与し又は助言を提供しているものの名称	190
(4) 契約外の信用補完等を提供している証券化目的導管体の名称及び当該証券化目的導管体ごとの当該契約外の信用補完等による自己資本への影響	190
(5) 証券化取引に関する会計方針	190
(6) 証券化エクスポージャーの種類ごとのリスク・ウェイトの判定に使用する適格格付機関の名称（使用する適格格付機関を変更した場合にあっては、その理由を含む。）	191
(7) 内部評価方式を使用している場合には、その概要	—

	三井住友トラスト・ホールディングス
8. CVAリスクに関する次に掲げる事項	
(1) CVAリスク相当額の算出に使用する手法（SA-CVA、完全なBA-CVA、限定的なBA-CVA又は簡便法をいう。）の名称及び各手法により算出される対象取引の概要	189
(2) CVAリスクの特性及びCVAに関するリスク管理体制の概要（CVAリスクのヘッジ方針及びヘッジの継続的な有効性を監視するための体制を含む。）	189
(3) SA-CVA採用行にあっては、次に掲げる事項	—
①CVAに関するリスク管理体制の概要（取締役等の関与の仕組みを含む。）	—
②CVAに関するリスク管理体制が有効に機能するための経営管理体制の概要（CVAに関するリスク管理の状況を示す書類の作成及び報告の状況並びにCVAエクスポージャー計測モデル検証部署及び内部監査部署の関与の状況を含む。）	—
9. マーケット・リスクに関する次に掲げる事項（持株自己資本比率告示第2条各号の算式にマーケット・リスク相当額に係る額を算入する場合に限る。）	
(1) リスク管理の方針、手続及び体制の概要（次に掲げる事項を含む。）	180～181
①リスクの特定、評価、管理及び削減に係る方法並びにヘッジの有効性に係る監視の方法	180～181
②トレーディング勘定に分類する商品の範囲を定めるための方針及び手続（低流動性ポジションの特定、管理及び監視に係る方法を含む。）	181
③トレーディング勘定とバンキング勘定との間の商品の振替を行った場合には、次に掲げる事項	
ア、当該振替を行った商品の市場価値及びグロスの公正価値	181
イ、当該振替の理由	—
④内部取引担当デスクのリスク移転の状況	182
(2) 報告及び計測に係るシステムの範囲並びにその内容	181
(3) トレーディング・デスク（バンキング勘定の外国為替リスクを保有する部門を含む。）の構造及び保有する商品の種類（内部モデル方式を用いてマーケット・リスク相当額を算出するトレーディング・デスクに限る。）	—
(4) 期待ショート・フォールモデルに関する次に掲げる事項（内部モデル方式の承認を受けたトレーディング・デスクに限る。）	
①適用する場合には、その範囲（トレーディング・デスクの概要を含む。）	—
②主要なトレーディング・デスクのうちストレステスト・フォール（SES）によりマーケット・リスク相当額を算出するものの概要	—
③マーケット・リスクに対する自己資本の充実度を内部的に評価する際に用いている各種の前提及び評価の方法（ストレステストを含む。）	—
④概要（計測手法の種類、信頼水準、保有期間、観測期間及び市場混乱時の特定方法等を含む。）	—
⑤使用するデータの更新頻度	—
⑥重要なポートフォリオに対するストレステストの結果の概要（モデル化可能なリスク・ファクター及び低減したリスク・ファクターによるマーケット・リスク相当額の算出過程を含む。）	—
(5) モデル化不可能なリスク・ファクターにおける自己資本の充実度を内部的に評価する際に用いている各種の前提及び評価の方法（内部モデル方式を用いている場合に限る。）	—
(6) DRCモデルに関する次に掲げる事項（内部モデル方式を用いる場合に限る。）	
①適用する場合には、その範囲（トレーディング・デスクの概要を含む。）	—
②概要（計測手法の種類、信頼水準、保有期間、観測期間、PDの前提及びエクスポージャーのネットティングの方法を含む。）	—
③自己資本の充実度を内部的に評価する際に用いている各種の前提及び評価の方法（自己資本比率告示第277条第3項各号に掲げる要件を含む。）	—
(7) モデル検証部署による内部モデル方式の設計及び運用に係る検証、一般的な手法、各種の前提並びに評価の方法（内部モデル方式を用いる場合に限る。）	—
10. オペレーショナル・リスクに関する次に掲げる事項	
(1) リスク管理の方針及び手続の概要	184～186
(2) BIの算出方法	186
(3) ILMの算出方法	186
(4) オペレーショナル・リスク相当額の算出に当たって、BIの算出から除外した連結子法人等又は事業部門の有無（連結子法人等又は事業部門を除外した場合にあっては、その理由を含む。）	186
(5) オペレーショナル・リスク相当額の算出に当たって、ILMの算出から除外した特殊損失の有無（特殊損失を除外した場合にあっては、その理由を含む。）	186
11. 信用リスク・アセットの額の算出対象となっている株式及び持株自己資本比率告示第54条第2項に規定する株式と同等の性質を有するものに対するエクスポージャー又は株式等エクスポージャー（以下「出資等又は株式等エクスポージャー」という。）に関するリスクの特性並びにリスク管理の方針、手続及び体制の概要	191～192
12. 金利リスク（マーケット・リスク相当額の算出対象となっているものを除く。別紙様式第2号第26面、第27面及び第29面を除く。）に関する次に掲げる事項	
(1) リスク管理の方針及び手続の概要	180、182
(2) 金利リスクの算定手法の概要	182～183
13. 連結貸借対照表の科目が別紙様式第5号に記載する項目のいずれに相当するかについての説明（別紙様式第14号 CC2）	199～208
14. 自己資本比率規制上のエクスポージャーの額と連結貸借対照表計上額との差異及びその要因に関する説明	214～216

	三井住友トラスト・ホールディングス
■ 定量的な開示事項	
1. その他金融機関等（持株自己資本比率告示第8条第8項第1号に規定するその他金融機関等をいう。）であって銀行持株会社の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の名称と所要自己資本を下回った額の総額	195
2. 信用リスク（カウンターパーティ信用リスク、証券化取引に係るリスク及びCVAリスク並びにリスク・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を除く。）に関する次に掲げる事項	
（1）次に掲げるエクスポージャーの区分ごとの期末残高及びそれらの主な種類別の内訳	
①地域別	209
②業種別	209
③残存期間別	209
（2）金融機能の再生のための緊急措置に関する法律施行規則（平成10年金融再生委員会規則第2号）第4条第2項、第3項又は第4項に規定する債権に係る債務者のエクスポージャーの期末残高、当該期末残高に対応して計上されている引当金の額及び当該エクスポージャーに係る償却額並びにこれらの次に掲げる区分ごとの内訳	
①地域別	210
②業種別	210
（3）延滞期間別のエクスポージャーの期末残高	210
（4）経営再建又は支援を図ることを目的として貸出条件の緩和を実施した債権（金融機能の再生のための緊急措置に関する法律施行規則第4条第2項に規定する破産更生債権及びこれらに準ずる債権、同条第3項に規定する危険債権又は同条第4項に規定する3月以上延滞債権に該当するものを除く。）に係る債務者のエクスポージャーの期末残高のうち、貸出条件の緩和を実施したことに伴い、当該エクスポージャーにかかる引当金の額を増加させたものの額及びそれ以外のものの額	210
3. リスク・ウェイトのみなし計算（持株自己資本比率告示第54条の5の規定によりリスク・ウェイトを算出することをいう。）又は信用リスク・アセットのみなし計算（持株自己資本比率告示第145条の規定により信用リスク・アセットの額を算出することをいう。）が適用されるエクスポージャーについて、次に掲げるエクスポージャーの区分ごとの額	
（1）持株自己資本比率告示第54条の5第2項の規定により算出した割合をリスク・ウェイトとして用いるエクスポージャー又は持株自己資本比率告示第145条第2項の規定により信用リスク・アセットの額を算出するエクスポージャー	211
（2）持株自己資本比率告示第54条の5第6項の規定により算出した割合をリスク・ウェイトとして用いるエクスポージャー又は持株自己資本比率告示第145条第7項の規定により信用リスク・アセットの額を算出するエクスポージャー	211
（3）持株自己資本比率告示第54条の5第9項第1号に定める比率をリスク・ウェイトとして用いるエクスポージャー又は持株自己資本比率告示第145条第10項第1号に定めるリスク・ウェイトを用いて信用リスク・アセットの額を算出するエクスポージャー	211
（4）持株自己資本比率告示第54条の5第9項第2号に定める比率をリスク・ウェイトとして用いるエクスポージャー又は持株自己資本比率告示第145条第10項第2号に定めるリスク・ウェイトを用いて信用リスク・アセットの額を算出するエクスポージャー	211
（5）持株自己資本比率告示第54条の5第10項のリスク・ウェイトを用いるエクスポージャー又は持株自己資本比率告示第145条第11項の規定により信用リスク・アセットの額を算出するエクスポージャー	211
■ 別紙様式第2号により作成する定量的な開示事項	
1. 第1面 OV1：リスク・アセットの概要	212～213
2. 第2面 LI1：会計上の連結範囲と自己資本比率規制上の連結範囲との間の差異及び連結対照表の区分と自己資本比率規制上のリスク・カテゴリーとの対応関係	214～215
3. 第3面 LI2：自己資本比率規制上のエクスポージャーの額と連結貸借対照表計上額との差異の主な要因	216
4. 第4面 CR1：資産の信用の質	217
5. 第5面 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	218
6. 第6面 CR3：信用リスク削減手法	218
7. 第7面 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	219～220
8. 第8面 CR5a：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	221～222
9. 第8面の2 CR5b：標準的手法－リスク・ウェイト区分別の信用リスク・エクスポージャーとCCF	223
10. 第9面 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	225～234
11. 第10面 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	235
12. 第11面 CR8：内部格付手法を適用した信用リスク・エクスポージャーのリスク・アセット変動表	236
13. 第12面 CR9：内部格付手法－ポートフォリオ別のデフォルト率（PD）のバック・テストング	237～240
14. 第13面 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）	241
15. 第14面 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	243
16. 第15面 CVA1：限定的なBA-CVA	243
17. 第15面の2 CVA2：完全なBA-CVA	244
18. 第15面の3 CVA3：SA-CVAのCVAリスク相当額と取引相手の先数	244
19. 第15面の4 CVA4：CVAリスク・エクスポージャーのCVAリスク相当額変動表	244
20. 第16面 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	245
21. 第17面 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	246～247
22. 第18面 CCR5：担保の内訳	248
23. 第19面 CCR6：クレジット・デリバティブ取引のエクスポージャー	249
24. 第20面 CCR7：期待エクスポージャー方式を用いたカウンターパーティ信用リスク・エクスポージャーのリスク・アセット変動表	249
25. 第21面 CCR8：中央清算機関向けエクスポージャー	250

	三井住友トラスト・ホールディングス
26. 第22面 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。）	251
27. 第23面 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。）	251
28. 第24面 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）	252～253
29. 第25面 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）	254～255
30. 第26面 MR1：標準的方式によるマーケット・リスク相当額	256
31. 第27面 MR2：内部モデル方式によるマーケット・リスク相当額に関する内訳	257
32. 第29面 MR3：簡易的方式によるマーケット・リスク相当額	257
33. 第30面 IRRBB1：金利リスク	259
34. 第31面 CCyB1：カウンター・シクリカル・バッファ比率に係る国又は地域別の状況	259
35. 第32面 GSIB1：G-SIB選定指標	260
36. 第33面 OR1：オペレーショナル・リスク損失の推移	261
37. 第34面 OR2：BICの構成要素	262
38. 第35面 OR3：オペレーショナル・リスクに対する所要自己資本額の概要	262
39. 第36面 ENC1：担保資産の状況	263
40. 第37面 CMS1：内部モデルを用いた手法と標準的手法のリスク・アセットの比較	263
41. 第38面 CMS2：ポートフォリオ別の内部格付手法と標準的手法の信用リスク・アセットの比較	264
■持株レバレッジ比率に関する開示事項	
1. 持株レバレッジ比率の構成に関する事項	265～267
2. 前連結会計年度の持株レバレッジ比率との間に著しい差異が生じた原因（当該差異がある場合に限る。）	—

[平成26年金融庁告示第7号第4条に定められた記載事項]

	三井住友信託銀行
■自己資本の構成に関する開示事項（別紙様式第5号 CC1）	280～282
■定性的な開示事項	
1. 連結の範囲に関する次に掲げる事項	
(1) 自己資本比率告示第3条の規定により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。）に属する会社と連結財務諸表規則第5条に規定する連結の範囲（特例企業会計基準等適用法人等（規則第14条の7第3項に規定する特例企業会計基準等適用法人等をいう。）にあっては、その採用する企業会計の基準における連結の範囲。以下「会計連結範囲」という。）に含まれる会社との相違点及び当該相違点の生じた原因	279
(2) 連結グループのうち、連結子会社の数並びに主要な連結子会社の名称及び主要な業務の内容	279
(3) 自己資本比率告示第9条の規定が適用される金融業務を営む関連法人等の数、名称、貸借対照表の総資産の額及び純資産の額並びに主要な業務の内容	279
(4) 連結グループに属する会社であって会計連結範囲に含まれないもの及び連結グループに属しない会社であって会計連結範囲に含まれるものの名称、貸借対照表の総資産の額及び純資産の額並びに主要な業務の内容	279
(5) 連結グループ内の資金及び自己資本の移動に係る制限等の概要	279
2. 連結グループの自己資本の充実度に関する評価方法の概要	168
3. 連結グループ（自己資本比率告示第3条の規定により連結自己資本比率を算出する対象となる会社の集団をいう。）全体のリスクの特性並びにリスク管理の方針、手続及び体制の概要	164～170
4. 信用リスク（派生商品取引及びレボ形式の取引等における取引の相手方に対する信用リスク並びに証券化取引に係るリスク及びCVAリスクを除く。）に関する次に掲げる事項	
(1) リスクの特性並びにリスク管理の方針、手続及び体制の概要	170～173
(2) 会計上の引当て及び償却に関する基準の概要	84、171、294
(3) 標準的手法採用行にあっては、エクスポージャーの種類ごとのリスク・ウェイトの判定に使用する適格格付機関等（適格格付機関、経済協力開発機構及び輸出信用機関をいう。）の名称（使用する適格格付機関等を変更した場合にあっては、その理由を含む。）	176
(4) 内部格付手法採用行にあっては、次に掲げる事項	
①信用リスク・アセットの額を算出する手法の種類ごとの資産区分別のEAD（標準的手法が適用されるポートフォリオにあっては、エクスポージャーの額。）がEADの総額に占める割合	178
②内部格付手法の適用範囲の決定に係る経緯	174、322
③内部格付制度の概要及び当該制度に関する次に掲げる事項の概要	
ア. 資産区分ごとの格付付与手続	174～175
イ. パラメータ推計（PD、LGD及びEADの推計をいう。）及びその検証体制	173～174、177、179
ウ. 内部格付制度並びに使用するモデルの開発及び管理等に係る運営体制	173～174、187
④標準的手法が適用されるエクスポージャー（別紙様式第2号第38面により作成するものに係るエクスポージャーに限る。）について、次に掲げる内部格付手法のポートフォリオに分類する場合の基準	
ア. ソブリン向けエクスポージャー	176
イ. 金融機関等向けエクスポージャー	176
ウ. 株式等エクスポージャー	176
エ. 購入債権	176
オ. 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。）	176
カ. 中堅中小企業向けエクスポージャー	176
キ. 居住用不動産向けエクスポージャー	176
ク. 適格リボルビング型リテール向けエクスポージャー	176

	三井住友信託銀行
ケ. その他リテール向けエクスポージャー	176
コ. 特定貸付債権	176
サ. 事業用不動産向け貸付け及びボラティリティの高い事業用不動産向け貸付け	176
⑤内部格付手法を段階的に適用する計画の有無に応じた所定の事項	174、176
5. 信用リスク削減手法（派生商品取引、レポ形式の取引、信用取引、有価証券の貸付け、現金又は有価証券による担保の提供、長期決済期間取引その他これらに類する取引（以下「派生商品取引及びレポ形式の取引等」という。）に関連して用いられる信用リスク削減手法を除く。）に関するリスクの特性並びにリスク管理の方針、手続及び体制の概要	187～188
6. 派生商品取引及びレポ形式の取引等における取引の相手方に対する信用リスク（以下「カウンターパーティ信用リスク」という。）に関するリスクの特性並びにリスク管理の方針、手続及び体制の概要（当該カウンターパーティ信用リスクの削減手法に関するものを含む。）	188～189
7. 証券化取引に係るリスクに関する次に掲げる事項	
（1）リスクの特性並びにリスク管理の方針、手続及び体制の概要	189～190
（2）自己資本比率告示第248条第1項第1号から第4号まで（自己資本比率告示第302条の2第2項において準用する場合を含む。）に規定する体制の整備及びその運用状況の概要	191
（3）証券化目的導管体を用いて第三者の資産に係る証券化取引を行った場合には、当該証券化目的導管体の名称及び当該証券化取引に係る証券化エクスポージャーを保有しているかどうかの別並びに連結グループの子法人等（連結子法人等を除く。）及び関連法人等のうち、当該連結グループが行った証券化取引（当該連結グループが証券化目的導管体を用いて行った証券化取引を含む。）に係る証券化エクスポージャーを保有し、かつ、当該連結グループがその経営に関与し又は助言を提供しているものの名称	190
（4）契約外の信用補完等を提供している証券化目的導管体の名称及び当該証券化目的導管体ごとの当該契約外の信用補完等による自己資本への影響	190
（5）証券化取引に関する会計方針	190
（6）証券化エクスポージャーの種類ごとのリスク・ウェイトの判定に使用する適格格付機関の名称（使用する適格格付機関を変更した場合にあっては、その理由を含む。）	191
（7）内部評価方式を使用している場合には、その概要	—
8. CVAリスクに関する次に掲げる事項	
（1）CVAリスク相当額の算出に使用する手法（SA-CVA、完全なBA-CVA、限定的なBA-CVA又は簡便法をいう。）の名称及び各手法により算出される対象取引の概要	189
（2）CVAリスクの特性及びCVAに関するリスク管理体制の概要（CVAリスクのヘッジ方針及びヘッジの継続的な有効性を監視するための体制を含む。）	189
（3）SA-CVA採用行にあっては、次に掲げる事項	—
①CVAに関するリスク管理体制の概要（取締役等の関与の仕組みを含む。）	—
②CVAに関するリスク管理体制が有効に機能するための経営管理体制の概要（CVAに関するリスク管理の状況を示す書類の作成及び報告の状況並びにCVAエクスポージャー計測モデル検証部署及び内部監査部署の関与の状況を含む。）	—
9. マーケット・リスクに関する次に掲げる事項（自己資本比率告示第2条各号の算式にマーケット・リスク相当額に係る額を算入する場合に限る。）	
（1）リスク管理の方針、手続及び体制の概要（次に掲げる事項を含む。）	180～181
①リスクの特定、評価、管理及び削減に係る方法並びにヘッジの有効性に係る監視の方法	180～181
②トレーディング勘定に分類する商品の範囲を定めるための方針及び手続（低流動性ポジションの特定、管理及び監視に係る方法を含む。）	181
③トレーディング勘定とバンキング勘定との間の商品の振替を行った場合には、次に掲げる事項	
ア. 当該振替を行った商品の市場価値及びグロスの公正価値	181
イ. 当該振替の理由	—
④内部取引担当デスクのリスク移転の状況	182
（2）報告及び計測に係るシステムの範囲並びにその内容	181
（3）トレーディング・デスク（バンキング勘定の外国為替リスクを保有する部門を含む。）の構造及び保有する商品の種類（内部モデル方式を用いてマーケット・リスク相当額を算出するトレーディング・デスクに限る。）	—
（4）期待ショート・フォールモデルに関する次に掲げる事項（内部モデル方式の承認を受けたトレーディング・デスクに限る。）	
①適用する場合には、その範囲（トレーディング・デスクの概要を含む。）	—
②主要なトレーディング・デスクのうちストレス期待ショート・フォール（SES）によりマーケット・リスク相当額を算出するものの概要	—
③マーケット・リスクに対する自己資本の充実度を内部的に評価する際に用いている各種の前提及び評価の方法（ストレス・テストを含む。）	—
④概要（計測手法の種類、信頼水準、保有期間、観測期間及び市場混乱時の特定方法等を含む。）	—
⑤使用するデータの更新頻度	—
⑥重要なポートフォリオに対するストレス・テストの結果の概要（モデル化可能なリスク・ファクター及び低減したリスク・ファクターによるマーケット・リスク相当額の算出過程を含む。）	—
（5）モデル化不可能なリスク・ファクターにおける自己資本の充実度を内部的に評価する際に用いている各種の前提及び評価の方法（内部モデル方式を用いている場合に限る。）	—
（6）DRCモデルに関する次に掲げる事項（内部モデル方式を用いる場合に限る。）	
①適用する場合には、その範囲（トレーディング・デスクの概要を含む。）	—
②概要（計測手法の種類、信頼水準、保有期間、観測期間、PDの前提及びエクスポージャーのネットティングの方法を含む。）	—
③自己資本の充実度を内部的に評価する際に用いている各種の前提及び評価の方法（自己資本比率告示第277条第3項各号に掲げる要件を含む。）	—
（7）モデル検証部署による内部モデル方式の設計及び運用に係る検証、一般的な手法、各種の前提並びに評価の方法（内部モデル方式を用いる場合に限る。）	—

三井住友信託銀行	
10. オペレーショナル・リスクに関する次に掲げる事項	
(1) リスク管理の方針及び手続の概要	184～186
(2) BIの算出方法	186
(3) ILMの算出方法	186
(4) オペレーショナル・リスク相当額の算出に当たって、BIの算出から除外した連結子法人等又は事業部門の有無（連結子法人等又は事業部門を除外した場合にあっては、その理由を含む。）	186
(5) オペレーショナル・リスク相当額の算出に当たって、ILMの算出から除外した特殊損失の有無（特殊損失を除外した場合にあっては、その理由を含む。）	186
11. 信用リスク・アセットの額の算出対象となっている株式及び自己資本比率告示第76条第2項に規定する株式と同等の性質を有するものに対するエクスポージャー又は株式等エクスポージャー（以下「出資等又は株式等エクスポージャー」という。）に関するリスクの特性並びにリスク管理の方針、手続及び体制の概要	191～192
12. 金利リスク（マーケット・リスク相当額の算出対象となっているものを除く。別紙様式第2号第26面、第27面及び第29面を除く。）に関する次に掲げる事項	
(1) リスク管理の方針及び手続の概要	180、182
(2) 金利リスクの算定手法の概要	182～183
13. 連結貸借対照表の科目が別紙様式第5号に記載する項目のいずれに相当するかについての説明（別紙様式第14号 CC2）	283～292
14. 自己資本比率規制上のエクスポージャーの額と連結貸借対照表計上額との差異及びその要因に関する説明	298～300
■ 定量的な開示事項	
1. その他金融機関等（自己資本比率告示第8条第8項第1号に規定するその他金融機関等をいう。）であって銀行の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の名称及び所要自己資本を下回った額の総額	279
2. 信用リスク（カウンターパーティ信用リスク、証券化取引に係るリスク及びCVAリスク並びにリスク・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を除く。）に関する次に掲げる事項	
(1) 次に掲げるエクスポージャーの区分ごとの期末残高及びそれらの主な種類別の内訳	
①地域別	293
②業種別	293
③残存期間別	293
(2) 金融機能の再生のための緊急措置に関する法律施行規則（平成10年金融再生委員会規則第2号）第4条第2項、第3項又は第4項に規定する債権に係る債務者のエクスポージャーの期末残高、当該期末残高に対応して計上されている引当金の額及び当該エクスポージャーに係る償却額並びにこれらの次に掲げる区分ごとの内訳	
①地域別	294
②業種別	294
(3) 延滞期間別のエクスポージャーの期末残高	294
(4) 経営再建又は支援を図ることを目的として貸出条件の緩和を実施した債権（金融機能の再生のための緊急措置に関する法律施行規則第4条第2項に規定する破産更生債権及びこれらに準ずる債権、同条第3項に規定する危険債権又は同条第4項に規定する3月以上延滞債権に該当するものを除く。）に係る債務者のエクスポージャーの期末残高のうち、貸出条件の緩和を実施したことに伴い、当該エクスポージャーにかかる引当金の額を増加させたものの額及びそれ以外のものの額	294
3. リスク・ウェイトのみなし計算（自己資本比率告示第76条の5の規定によりリスク・ウェイトを算出することをいう。）又は信用リスク・アセットのみなし計算（自己資本比率告示第167条の規定により信用リスク・アセットの額を算出することをいう。）が適用されるエクスポージャーについて、次に掲げるエクスポージャーの区分ごとの額	
(1) 自己資本比率告示第76条の5第2項の規定により算出した割合をリスク・ウェイトとして用いるエクスポージャー又は自己資本比率告示第167条第2項の規定により信用リスク・アセットの額を算出するエクスポージャー	295
(2) 自己資本比率告示第76条の5第6項の規定により算出した割合をリスク・ウェイトとして用いるエクスポージャー又は自己資本比率告示第167条第7項の規定により信用リスク・アセットの額を算出するエクスポージャー	295
(3) 自己資本比率告示第76条の5第9項第1号に定める比率をリスク・ウェイトとして用いるエクスポージャー又は自己資本比率告示第167条第10項第1号に定めるリスク・ウェイトを用いて信用リスク・アセットの額を算出するエクスポージャー	295
(4) 自己資本比率告示第76条の5第9項第2号に定める比率をリスク・ウェイトとして用いるエクスポージャー又は自己資本比率告示第167条第10項第2号に定めるリスク・ウェイトを用いて信用リスク・アセットの額を算出するエクスポージャー	295
(5) 自己資本比率告示第76条の5第10項のリスク・ウェイトを用いるエクスポージャー又は自己資本比率告示第167条第11項の規定により信用リスク・アセットの額を算出するエクスポージャー	295
■ 別紙様式第2号により作成する定量的な開示事項	
1. 第1面 OV1：リスク・アセットの概要	296～297
2. 第2面 LI1：会計上の連結範囲と自己資本比率規制上の連結範囲との間の差異及び連結対照表の区分と自己資本比率規制上のリスク・カテゴリーとの対応関係	298～299
3. 第3面 LI2：自己資本比率規制上のエクスポージャーの額と連結貸借対照表計上額との差異の主な要因	300
4. 第4面 CR1：資産の信用の質	301
5. 第5面 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	302
6. 第6面 CR3：信用リスク削減手法	302
7. 第7面 CR4：標準的手法一信用リスク・エクスポージャーと信用リスク削減手法の効果	303～304
8. 第8面 CR5a：標準的手法一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	305～306
9. 第8面の2 CR5b：標準的手法一リスク・ウェイト区分別の信用リスク・エクスポージャーとCCF	307
10. 第9面 CR6：内部格付手法一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	309～318
11. 第10面 CR7：内部格付手法一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	319
12. 第11面 CR8：内部格付手法を適用した信用リスク・エクスポージャーのリスク・アセット変動表	320

	三井住友信託銀行
13. 第12面 CR9：内部格付手法—ポートフォリオ別のデフォルト率（PD）のバック・テスト	321～324
14. 第13面 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）	325
15. 第14面 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	327
16. 第15面 CVA1：限定的なBA-CVA	327
17. 第15面の2 CVA2：完全なBA-CVA	328
18. 第15面の3 CVA3：SA-CVAのCVAリスク相当額と取引相手の先数	328
19. 第15面の4 CVA4：CVAリスク・エクスポージャーのCVAリスク相当額変動表	328
20. 第16面 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	329
21. 第17面 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	330～331
22. 第18面 CCR5：担保の内訳	332
23. 第19面 CCR6：クレジット・デリバティブ取引のエクスポージャー	333
24. 第20面 CCR7：期待エクスポージャー方式を用いたカウンターパーティ信用リスク・エクスポージャーのリスク・アセット変動表	333
25. 第21面 CCR8：中央清算機関向けエクスポージャー	334
26. 第22面 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。）	335
27. 第23面 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。）	335
28. 第24面 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）	336～337
29. 第25面 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）	338～339
30. 第26面 MR1：標準的方式によるマーケット・リスク相当額	340
31. 第27面 MR2：内部モデル方式によるマーケット・リスク相当額に関する内訳	341
32. 第29面 MR3：簡易的方式によるマーケット・リスク相当額	341
33. 第30面 IRRBB1：金利リスク	343
34. 第33面 OR1：オペレーショナル・リスク損失の推移	343
35. 第34面 OR2：BICの構成要素	344
36. 第35面 OR3：オペレーショナル・リスクに対する所要自己資本額の概要	344
37. 第36面 ENC1：担保資産の状況	345
38. 第37面 CMS1：内部モデルを用いた手法と標準の手法のリスク・アセットの比較	345
39. 第38面 CMS2：ポートフォリオ別の内部格付手法と標準の手法の信用リスク・アセットの比較	346
■連結レバレッジ比率に関する開示事項	
1. 連結レバレッジ比率の構成に関する事項	347～349
2. 前連結会計年度の連結レバレッジ比率との間に著しい差異が生じた原因（当該差異がある場合に限る。）	—

[平成26年金融庁告示第7号第2条に定められた記載事項]

	三井住友信託銀行
■自己資本の構成に関する開示事項（別紙様式第1号 CC1）	355～357
■定性的な開示事項	
1. 金利リスク（マーケット・リスク相当額の算出対象となっているものを除く。別紙様式第2号第26面、第27面及び第29面を除く。）に関する次に掲げる事項	
（1）リスク管理の方針及び手続の概要	180、182
（2）金利リスクの算定手法の概要	182～183
2. 貸借対照表の科目が別紙様式第1号に記載する項目のいずれに相当するかについての説明（別紙様式第13号 CC2）	358～367
■別紙様式第2号により作成する定量的な開示事項	
1. 第1面 OV1：リスク・アセットの概要	368～369
2. 第30面 IRRBB1：金利リスク	370
■単体レバレッジ比率に関する開示事項	
1. 単体レバレッジ比率の構成に関する事項	371～373
2. 前事業年度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（当該差異がある場合に限る。）	—

[平成26年金融庁告示第7号第9条第1項に定められた記載事項]

	三井住友トラスト・ホールディングス
■銀行持株会社における四半期の開示事項	
1. 自己資本の構成に関する開示事項	196～198
2. 持株自己資本比率告示第3条の規定に従い連結財務諸表を作成したと仮定した場合における連結貸借対照表の各科目の額及びこれらの科目が自己資本の構成に関する開示事項である別紙様式第5号に記載する項目のいずれに相当するかについての説明	199～208
3. 自己資本調達手段（その額の全部又は一部が、持株自己資本比率告示第2条第1号の算式における普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額、同条第2号の算式におけるその他Tier1資本に係る基礎項目の額又は同条第3号の算式におけるTier2資本に係る基礎項目の額に含まれる資本調達手段をいう。）に関する契約内容の概要	199
4. 自己資本調達手段に関する契約内容の詳細（3.に掲げる事項を除く。）	199
5. 持株自己資本比率告示第2条及び第2条の2に規定する基準に関する開示事項（別紙様式第10号 KM1：主要な指標）	194
6. 採用する企業会計の基準を変更した場合にあっては、対象となる四半期の末日における変更前と変更後との企業会計の基準による連結自己資本比率の対比及び要因分析（当該連結自己資本比率に著しい差異がある場合に限る。）	—
7. 持株レバレッジ比率の構成に関する事項	265～267
8. 前四半期の持株レバレッジ比率との間に著しい差異が生じた原因（当該差異がある場合に限る。）	—
9. 持株レバレッジ比率に関する事項	265～267
10. 採用する企業会計の基準を変更した場合にあっては、対象となる四半期の末日における変更前と変更後との企業会計の基準による持株レバレッジ比率の対比及び要因分析（当該持株レバレッジ比率に著しい差異がある場合に限る。）	—

[平成26年金融庁告示第7号第6条第2項に定められた記載事項]

	三井住友信託銀行
■銀行における四半期の開示事項	
1. 自己資本の構成に関する開示事項	280～282
2. 自己資本比率告示第3条の規定に従い連結財務諸表を作成したと仮定した場合における連結貸借対照表の各科目の額及びこれらの科目が自己資本の構成に関する開示事項である別紙様式第5号に記載する項目のいずれに相当するかについての説明	283～292
3. 自己資本調達手段（その額の全部又は一部が、自己資本比率告示第2条第1号の算式における普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額、同条第2号の算式におけるその他Tier1資本に係る基礎項目の額又は同条第3号の算式におけるTier2資本に係る基礎項目の額に含まれる資本調達手段をいう。）に関する契約内容の概要	283
4. 自己資本調達手段に関する契約内容の詳細（3.に掲げる事項を除く。）	283
5. 自己資本比率告示第2条及び第2条の2に規定する基準に関する開示事項（別紙様式第10号 KM1：主要な指標）	278
6. 採用する企業会計の基準を変更した場合にあっては、対象となる四半期の末日における変更前と変更後との企業会計の基準による連結自己資本比率の対比及び要因分析（当該連結自己資本比率に著しい差異がある場合に限る。）	—
7. 連結レバレッジ比率の構成に関する事項	347～349
8. 前四半期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（当該差異がある場合に限る。）	—
9. 連結レバレッジ比率に関する事項	347～349
10. 採用する企業会計の基準を変更した場合にあっては、対象となる四半期の末日における変更前と変更後との企業会計の基準による連結レバレッジ比率の対比及び要因分析（当該連結レバレッジ比率に著しい差異がある場合に限る。）	—

[平成26年金融庁告示第7号第6条第1項に定められた記載事項]

	三井住友信託銀行
■銀行における四半期の開示事項	
1. 自己資本の構成に関する開示事項	355～357
2. 貸借対照表の科目が自己資本の構成に関する開示事項である別紙様式第1号に記載する項目のいずれに相当するかについての説明	358～367
3. 自己資本調達手段（その額の全部又は一部が、自己資本比率告示第14条第1号の算式における普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額、同条第2号の算式におけるその他Tier1資本に係る基礎項目の額又は同条第3号の算式におけるTier2資本に係る基礎項目の額に含まれる資本調達手段をいう。）に関する契約内容の概要	283
4. 自己資本調達手段に関する契約内容の詳細（3.に掲げる事項を除く。）	283
5. 自己資本比率告示第14条及び第14条の2に規定する基準に関する開示事項（別紙様式第9号 KM1：主要な指標）	354
6. 単体レバレッジ比率の構成に関する事項	371～373
7. 前四半期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（当該差異がある場合に限る。）	—
8. 単体レバレッジ比率に関する事項	371～373

[平成27年金融庁告示第7号第7条第1項第1号に定められた記載事項]

	三井住友トラスト・ホールディングス
■連結流動性リスク管理に係る開示事項	
1. 流動性に係るリスク管理の方針及び手続の概要に関する事項	183
2. 流動性に係るリスク管理上の指標に関する事項	183
3. その他流動性に係るリスク管理に関する事項	183

[平成27年金融庁告示第7号第7条第1項第2号に定められた記載事項]

	三井住友トラスト・ホールディングス
■連結流動性カバレッジ比率に関する定性的開示事項	
1. 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	268
2. 連結流動性カバレッジ比率の水準の評価に関する事項	268
3. 算入可能適格流動資産の合計額の内容に関する事項	268
4. その他連結流動性カバレッジ比率に関する事項	268

[平成27年金融庁告示第7号第7条第1項第3号に定められた記載事項]

	三井住友トラスト・ホールディングス
■連結安定調達比率に関する定性的開示事項	
1. 時系列における連結安定調達比率の変動に関する事項	271
2. 持株流動性比率告示第99条各号に掲げる要件を満たす場合には、その旨	271
3. その他連結安定調達比率に関する事項	271

[平成27年金融庁告示第7号第4条第1項第1号に定められた記載事項]

	三井住友信託銀行
■連結流動性リスク管理に係る開示事項	
1. 流動性に係るリスク管理の方針及び手続の概要に関する事項	183
2. 流動性に係るリスク管理上の指標に関する事項	183
3. その他流動性に係るリスク管理に関する事項	183

[平成27年金融庁告示第7号第4条第1項第2号に定められた記載事項]

	三井住友信託銀行
■連結流動性カバレッジ比率に関する定性的開示事項	
1. 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	350
2. 連結流動性カバレッジ比率の水準の評価に関する事項	350
3. 算入可能適格流動資産の合計額の内容に関する事項	350
4. その他連結流動性カバレッジ比率に関する事項	350

[平成27年金融庁告示第7号第4条第1項第3号に定められた記載事項]

	三井住友信託銀行
■連結安定調達比率に関する定性的開示事項	
1. 時系列における連結安定調達比率の変動に関する事項	353
2. 流動性比率告示第101条各号に掲げる要件を満たす場合には、その旨	353
3. その他連結安定調達比率に関する事項	353

[平成27年金融庁告示第7号第2条第1項第1号に定められた記載事項]

	三井住友信託銀行
■単体流動性リスク管理に係る開示事項	
1. 流動性に係るリスク管理の方針及び手続の概要に関する事項	183
2. 流動性に係るリスク管理上の指標に関する事項	183
3. その他流動性に係るリスク管理に関する事項	183

[平成27年金融庁告示第7号第2条第1項第2号に定められた記載事項]

	三井住友信託銀行
■単体流動性カバレッジ比率に関する定性的開示事項	
1. 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	374
2. 単体流動性カバレッジ比率の水準の評価に関する事項	374
3. 算入可能適格流動資産の合計額の内容に関する事項	374
4. その他単体流動性カバレッジ比率に関する事項	374

[平成27年金融庁告示第7号第2条第1項第3号に定められた記載事項]

	三井住友信託銀行
■単体安定調達比率に関する定性的開示事項	
1. 時系列における単体安定調達比率の変動に関する事項	377
2. 流動性比率告示第101条各号に掲げる要件を満たす場合には、その旨	377
3. その他単体安定調達比率に関する事項	377

[平成27年金融庁告示第7号第9条に定められた記載事項]

	三井住友トラスト・ホールディングス
■銀行持株会社における四半期の開示事項	
1. 連結流動性力バレッジ比率に関する定量的開示事項	
(1) 別紙様式第2号 KM1：主要な指標	194
(2) 別紙様式第4号	268
2. 連結安定調達比率に関する定量的開示事項	
(1) 別紙様式第2号 KM1：主要な指標	194
(2) 別紙様式第6号	269～270
3. 採用する企業会計の基準を変更した場合にあっては、対象となる四半期の末日における変更前と変更後の企業会計の基準による連結流動性力バレッジ比率及び連結安定調達比率の対比及び要因分析（当該連結流動性力バレッジ比率及び連結安定調達比率に著しい差異がある場合に限る。）	—

[平成27年金融庁告示第7号第6条に定められた記載事項]

	三井住友信託銀行
■銀行における四半期の開示事項	
1. 単体流動性力バレッジ比率に関する定量的開示事項	
(1) 別紙様式第1号 KM1：主要な指標	354
(2) 別紙様式第3号	374
2. 連結流動性力バレッジ比率に関する定量的開示事項	
(1) 別紙様式第2号 KM1：主要な指標	278
(2) 別紙様式第4号	350
3. 単体安定調達比率に関する定量的開示事項	
(1) 別紙様式第1号 KM1：主要な指標	354
(2) 別紙様式第5号	375～376
4. 連結安定調達比率に関する定量的開示事項	
(1) 別紙様式第2号 KM1：主要な指標	278
(2) 別紙様式第6号	351～352
5. 採用する企業会計の基準を変更した場合にあっては、対象となる四半期の末日における変更前と変更後の企業会計の基準による単体流動性力バレッジ比率及び単体安定調達比率の対比及び要因分析（当該単体流動性力バレッジ比率及び単体安定調達比率に著しい差異がある場合に限る。）	—
6. 採用する企業会計の基準を変更した場合にあっては、対象となる四半期の末日における変更前と変更後の企業会計の基準による連結流動性力バレッジ比率及び連結安定調達比率の対比及び要因分析（当該連結流動性力バレッジ比率及び連結安定調達比率に著しい差異がある場合に限る。）	—