

単体レバレッジ比率の構成に関する開示事項(2021年3月期第3四半期)

【三井住友信託銀行】

(単位:百万円、%)

国際様式 (表2)の 該当番号	国際様式 (表1)の 該当番号	項目	2020年 12月末	2020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	41,455,905	40,096,109
	1a	1 貸借対照表における総資産の額	44,042,586	42,598,656
	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(△)	2,586,680	2,502,547
2	7	Tier1資本に係る調整項目の額(△)	189,574	183,700
3		オン・バランス資産の額 (イ)	41,266,331	39,912,408
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	545,212	534,753
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	969,556	934,748
		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	541,997	516,924
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(△)	192,387	190,551
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	46,905	65,600
10		クレジット・デリバティブのプロテクションを提供した場合における調整後想定元本の額から控除した額(△)	46,900	63,600
11	4	デリバティブ取引等に関する額 (ロ)	1,864,383	1,797,875
レボ取引等に関する額				
12		レボ取引等に関する資産の額	920,855	924,627
13		レボ取引等に関する資産の額から控除した額(△)	-	-
14		レボ取引等に関するカウンターパーティ・リスクのエクスポージャーの額	332,148	290,995
15		代理取引のエクスポージャーの額		
16	5	レボ取引等に関する額 (ハ)	1,253,004	1,215,622
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	5,849,882	5,707,577
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(△)	2,929,142	2,828,388
19	6	オフ・バランス取引に関する額 (ニ)	2,920,739	2,879,188
単体レバレッジ比率				
20		資本の額 (ホ)	2,127,382	2,214,965
21	8	総エクスポージャーの額((イ)+(ロ)+(ハ)+(ニ)) (ヘ)	47,304,459	45,805,095
22		単体レバレッジ比率((ホ)/(ヘ))	4.49%	4.83%
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)	47,304,459	45,805,095
		日本銀行に対する預け金の額	14,664,363	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')	61,968,822	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'))	3.43%	3.62%