

持株レバレッジ比率の構成に関する事項(2021年3月期第3四半期)

【三井住友トラスト・ホールディングス】

(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	43,317,064	41,949,555
1a	1	連結貸借対照表における総資産の額	46,033,718	44,586,069
1b	2	持株レバレッジ比率の範囲に含まれない子法人等の資産の額(△)	-	-
1c	7	持株レバレッジ比率の範囲に含まれる子会社の資産の額(連結貸借対照表における総資産の額に含まれる額を除く。)	-	-
1d	3	連結貸借対照表における総資産の額から控除される調整項目以外の資産の額(△)	2,716,654	2,636,513
2	7	Tier1資本に係る調整項目の額(△)	177,562	172,271
3		オン・バランス資産の額 (イ)	43,139,502	41,777,283
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	545,395	535,947
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	973,804	938,353
		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		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(△)	192,387	190,551
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	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)	1,868,815	1,802,673
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	350,240	292,062
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)	1,271,096	1,216,689
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	8,376,513	8,192,722
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(△)	5,260,697	5,141,822
19	6	オフ・バランス取引に関する額 (ニ)	3,115,816	3,050,899
持株レバレッジ比率				
20		資本の額 (ホ)	2,731,950	2,802,616
21	8	総エクスポージャーの額((イ)+(ロ)+(ハ)+(ニ)) (ヘ)	49,395,230	47,847,547
22		持株レバレッジ比率((ホ)/(ヘ))	5.53%	5.85%
日本銀行に対する預け金を算入する場合の持株レバレッジ比率				
		総エクスポージャーの額 (ヘ)	49,395,230	47,847,547
		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')	64,059,594	63,105,102
		日本銀行に対する預け金を算入する場合の持株レバレッジ比率((ホ)/(ヘ'))	4.26%	4.44%