

連結レバレッジ比率の構成に関する開示事項(2022年3月期第1四半期)

【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	2021年 6月末	2021年 3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	42,684,249	42,737,760
1a	1	連結貸借対照表における総資産の額*	46,695,150	46,917,808
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(△)*	4,010,901	4,180,048
2	7	Tier1資本に係る調整項目の額(△)	231,567	225,413
3		オン・バランス資産の額 (イ)	42,452,681	42,512,347
<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	546,693	716,497
5		デリバティブ取引等に関するPFEの額に1.4を乗じた額		
		デリバティブ取引等に関するアドオンの額	1,032,323	1,037,147
		デリバティブ取引等に関連して現金で差入れた証拠金の対価の額	581,074	562,953
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(△)	184,611	169,107
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	37,972	40,500
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(△)	36,000	40,500
11	4	デリバティブ取引等に関する額 (ロ)	1,977,452	2,147,492
<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	887,126	887,958
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	347,040	307,438
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)	1,234,166	1,195,397
<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	8,119,904	8,653,606
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(△)	5,026,758	5,261,730
19	6	オフ・バランス取引に関する額 (ニ)	3,093,145	3,391,875
<b>連結レバレッジ比率</b>				
20		資本の額 (ホ)	2,400,860	2,389,620
21	8	総エクスポージャーの額((イ)+(ロ)+(ハ)+(ニ)) (ヘ)	48,757,446	49,247,112
22		連結レバレッジ比率((ホ)/(ヘ))	4.92%	4.85%
<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)	48,757,446	49,247,112
		日本銀行に対する預け金の額	15,644,168	16,231,435
		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')	64,401,614	65,478,547
		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'))	3.72%	3.64%

\*従来、デリバティブ取引に関して金融商品会計に関する実務指針に定める要件を満たす取引については相殺して表示しておりましたが、当第1四半期会計期間より原則通り総額で表示する方法に変更しております。この表示方法の変更を反映させるため、前会計年度の財務諸表の組替えを行っております。