

単体レバレッジ比率の構成に関する開示事項(2022年3月期第2四半期(中間期))

【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 9月末	2021年 6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	41,129,471	40,987,173
	1a	1 貸借対照表における総資産の額	44,752,312	44,871,930
	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(△)	3,622,840	3,884,757
2	7	Tier1資本に係る調整項目の額(△)	217,299	213,134
3		オン・バランス資産の額 (イ)	40,912,172	40,774,038
<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	545,728	544,786
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	1,046,743	1,029,398
		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	566,862	581,074
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(△)	166,684	184,611
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	37,934	37,972
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	36,000
11	4	デリバティブ取引等に関する額 (ロ)	1,994,584	1,972,621
<b>レボ取引等に関する額</b>				
12		レボ取引等に関する資産の額	840,833	887,126
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	299,056	336,956
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)	1,139,890	1,224,082
<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	5,511,437	5,576,533
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(△)	2,692,747	2,708,757
19	6	オフ・バランス取引に関する額 (ニ)	2,818,689	2,867,776
<b>単体レバレッジ比率</b>				
20		資本の額 (ホ)	2,161,597	2,138,961
21	8	総エクスポージャーの額((イ)+(ロ)+(ハ)+(ニ)) (ヘ)	46,865,337	46,838,519
22		単体レバレッジ比率((ホ)/(ヘ))	4.61%	4.56%
<b>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</b>				
		総エクスポージャーの額 (ヘ)	46,865,337	46,838,519
		日本銀行に対する預け金の額	16,503,707	15,644,168
		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')	63,369,045	62,482,687
		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'))	3.41%	3.42%