

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	2021年 12月末	2021年 9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	41,550,332	41,129,471
	1a	1 貸借対照表における総資産の額	45,068,016	44,752,312
	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(△)	3,517,684	3,622,840
2	7	Tier1資本に係る調整項目の額(△)	225,319	217,299
3		オン・バランス資産の額 (イ)	41,325,012	40,912,172
<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	595,696	545,728
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	1,046,200	1,046,743
		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	546,579	566,862
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(△)	165,249	166,684
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	31,454	37,934
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(△)	29,500	36,000
11	4	デリバティブ取引等に関する額 (ロ)	2,025,181	1,994,584
<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	800,762	840,833
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	352,423	299,056
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)	1,153,185	1,139,890
<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	5,671,381	5,511,437
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(△)	2,717,033	2,692,747
19	6	オフ・バランス取引に関する額 (ニ)	2,954,347	2,818,689
<b>単体レバレッジ比率</b>				
20		資本の額 (ホ)	2,161,726	2,161,597
21	8	総エクスポージャーの額((イ)+(ロ)+(ハ)+(ニ)) (ヘ)	47,457,727	46,865,337
22		単体レバレッジ比率(ホ)/(ヘ)	4.55%	4.61%
<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)	47,457,727	46,865,337
		日本銀行に対する預け金の額	16,496,331	16,503,707
		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')	63,954,059	63,369,045
		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')	3.38%	3.41%