

## 持株レバレッジ比率の構成に関する事項(平成28年3月期)

【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<br>(表2)の<br>該当番号 | 国際様式<br>(表1)の<br>該当番号 | 項目  | 平成28年<br>3月末 | 平成27年<br>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                                   | 55,694,009   | 43,580,192   |
| 1a                    | 1                     | 連結貸借対照表における総資産の額                                      | 58,229,948   | 46,235,949   |
| 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(△)                 | 2,535,938    | 2,655,756    |
| 2                     | 7                     | Tier1資本に係る調整項目の額(△)                                   | 197,805      | 204,240      |
| 3                     |                       | オン・バランス資産の額 (イ)                                       | 55,496,204   | 43,375,952   |
| <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再構築コストの額                                 | 571,207      | 570,299      |
| 5                     |                       | デリバティブ取引等に関するアドオンの額                                   | 889,596      | 760,819      |
|                       |                       | 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                        | 494,847      | 672,492      |
| 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(△)           | 317,580      | 539,592      |
| 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              | 77,279       | 53,809       |
| 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(△)    | 70,900       | 47,800       |
| 11                    | 4                     | デリバティブ取引等に関する額 (ロ)                                    | 1,644,449    | 1,470,028    |
| <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   | 436,834      | 446,995      |
| 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                     | 38,271       | 32,671       |
| 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)  | 475,106      | 479,667      |
| <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                                      | 7,570,074    | 5,229,386    |
| 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(△)                     | 4,803,025    | 2,774,318    |
| 19                    | 6                     | オフ・バランス取引に関する額 (ニ)                                    | 2,767,049    | 2,455,068    |
| <b>持株レバレッジ比率</b>      |                       |   |              |              |
| 20                    |                       | 資本の額 (ホ)  | 2,415,375    | 2,160,677    |
| 21                    | 8                     | 総エクスポージャーの額((イ)+(ロ)+(ハ)+(ニ)) (ヘ)                      | 60,382,809   | 47,780,716   |
| 22                    |                       | 持株レバレッジ比率((ホ)/(ヘ))                                    | 4.00%        | 4.52%        |

## 前連結会計年度の持株レバレッジ比率との間に著しい差異が生じた原因(平成28年3月期)

日本銀行によるマイナス金利政策導入を背景に、信託勘定から短期運用資金が銀行勘定に流入し、日銀当座預金が増加したことにより、総エクスポージャーの額が増加したもの。