

持株レバレッジ比率の構成に関する事項(2019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	2018年 12月末	2018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	54,364,929	67,355,088
1a	1	連結貸借対照表における総資産の額	57,069,112	70,001,204
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(△)	2,704,183	2,646,115
2	7	Tier1資本に係る調整項目の額(△)	275,768	289,889
3		オン・バランス資産の額 (イ)	54,089,160	67,065,199
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再構築コストの額	314,336	475,917
5		デリバティブ取引等に関するアドオンの額	942,313	973,174
		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	628,495	605,319
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(△)	195,569	186,460
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	83,172	86,400
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(△)	83,172	86,400
11	4	デリバティブ取引等に関する額 (ロ)	1,689,576	1,867,950
レポ取引等に関する額				
12		レポ取引等に関する資産の額	903,060	759,290
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	254,346	144,227
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)	1,157,406	903,518
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	7,348,637	7,355,303
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(△)	4,726,884	4,755,593
19	6	オフ・バランス取引に関する額 (ニ)	2,621,752	2,599,709
持株レバレッジ比率				
20		資本の額 (ホ)	2,774,428	2,748,224
21	8	総エクスポージャーの額((イ)+(ロ)+(ハ)+(ニ)) (ヘ)	59,557,896	72,436,378
22		持株レバレッジ比率((ホ)/(ヘ))	4.65%	3.79%

前四半期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(2019年3月期第3四半期)

2018年10月の日本トラスティ・サービス信託銀行の経営統合に伴い、同社を連結の範囲から除外(持分法適用会社化)したことにより、総エクスポージャーの額が減少したものの。