

持株レバレッジ比率の構成に関する事項(2020年3月期第2四半期(中間期))

【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	2019年 9月末	2019年 6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	54,510,045	53,374,712
1a	1	連結貸借対照表における総資産の額	57,095,352	56,056,133
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(△)	2,585,307	2,681,420
2	7	Tier1資本に係る調整項目の額(△)	232,292	240,370
3		オン・バランス資産の額 (イ)	54,277,753	53,134,342
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	474,878	517,292
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	936,714	989,653
		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	425,309	428,245
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(△)	86,781	133,428
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	77,339	101,341
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(△)	57,300	63,000
11	4	デリバティブ取引等に関する額 (ロ)	1,770,161	1,840,104
レポ取引等に関する額				
12		レポ取引等に関する資産の額	900,489	930,561
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	299,187	252,908
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)	1,199,676	1,183,469
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	7,551,019	7,547,266
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(△)	4,683,930	4,627,768
19	6	オフ・バランス取引に関する額 (ニ)	2,867,088	2,919,498
持株レバレッジ比率				
20		資本の額 (ホ)	2,805,439	2,817,576
21	8	総エクスポージャーの額((イ)+(ロ)+(ハ)+(ニ)) (ヘ)	60,114,680	59,077,414
22		持株レバレッジ比率(ホ)/(ヘ)	4.66%	4.76%