

持株レバレッジ比率の構成に関する事項(2020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 (表2)の 該当番号	国際様式 (表1)の 該当番号	項目	2020年 3月末	2019年 12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	52,633,729	52,868,768
1a	1	連結貸借対照表における総資産の額	56,500,552	55,346,961
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(△)	3,866,823	2,478,192
2	7	Tier1資本に係る調整項目の額(△)	168,212	236,217
3		オン・バランス資産の額 (イ)	52,465,517	52,632,551
<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	650,790	456,183
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	904,492	919,994
		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	504,362	367,880
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(△)	169,673	137,560
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	74,034	92,789
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(△)	53,600	60,100
11	4	デリバティブ取引等に関する額 (ロ)	1,910,406	1,639,187
<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	1,961,419	907,461
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	287,850	256,409
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)	2,249,270	1,163,871
<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	7,426,754	6,703,760
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(△)	4,726,571	4,006,681
19	6	オフ・バランス取引に関する額 (ニ)	2,700,183	2,697,079
<b>持株レバレッジ比率</b>				
20		資本の額 (ホ)	2,758,167	2,820,867
21	8	総エクスポージャーの額((イ)+(ロ)+(ハ)+(ニ)) (ヘ)	59,325,377	58,132,689
22		持株レバレッジ比率((ホ)/(ヘ))	4.64%	4.85%