

単体レバレッジ比率の構成に関する事項

株式会社三井住友銀行（単体）

（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 6月末	2020年 3月末
オン・バランス資産の額 (1)				
1		調整項目控除前のオン・バランス資産の額	130,096,964	171,987,707
	1a	1 貸借対照表における総資産の額	149,354,330	193,963,791
	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 (△)	19,257,365	21,976,084
2	7	Tier1資本に係る調整項目の額 (△)	450,568	427,366
3		オン・バランス資産の額 (イ)	129,646,396	171,560,340
デリバティブ取引等に関する額 (2)				
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	3,274,566	3,412,019
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	2,253,453	2,201,998
		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	552,126	497,394
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 (△)	288,987	225,519
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	—	—
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 (△)	—	—
11	4	デリバティブ取引等に関する額 (ロ)	5,791,159	5,885,893
レポ取引等に関する額 (3)				
12		レポ取引等に関する資産の額	4,410,789	6,907,318
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	222,661	366,826
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)	4,633,451	7,274,144
オフ・バランス取引に関する額 (4)				
17		オフ・バランス取引の想定元本の額	57,535,653	53,501,369
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 (△)	33,970,034	31,790,200
19	6	オフ・バランス取引に関する額 (ニ)	23,565,618	21,711,168
単体レバレッジ比率 (5)				
20		資本の額 (ホ)	8,186,015	7,959,801
21	8	総エクスポージャーの額 (イ) + (ロ) + (ハ) + (ニ) (ヘ)	163,636,624	206,431,546
22		単体レバレッジ比率 (ホ) / (ヘ)	5.00%	3.85%
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 (6)				
		総エクスポージャーの額 (ヘ)	163,636,624	
		日本銀行に対する預け金の額	51,547,106	
		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')	215,183,731	
		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')	3.80%	

(注) 2020年3月末の単体レバレッジ比率との間に著しい差異を生じた要因

単体レバレッジ比率の上昇は、平成31年金融庁告示第11号（以下、告示）において、2020年6月30日付告示改正に伴い、日本銀行に対する預け金の額が総エクスポージャーの額より除外されたことによるもの