

連結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（連結）

（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 9月末	2020年 6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	136,109,425	139,260,114
	1a	1 連結貸借対照表における総資産の額	155,194,090	160,416,149
	1b	2 連結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 連結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（△）	19,084,665	21,156,034
2	7	Tier1資本に係る調整項目の額（△）	525,383	439,579
3		オン・バランス資産の額（イ）	135,584,041	138,820,534
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	2,304,598	3,730,075
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	3,019,827	2,944,941
		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	668,335	757,117
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（△）	127,643	113,232
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	56,781	24,038
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）	5,921,899	7,342,940
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	5,299,582	7,059,941
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	329,487	285,209
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）	5,629,070	7,345,151
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	62,015,821	59,871,484
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（△）	38,648,227	37,581,664
19	6	オフ・バランス取引に関する額（ニ）	23,367,593	22,289,820
連結レバレッジ比率（5）				
20		資本の額（ホ）	9,087,304	9,053,313
21	8	総エクスポージャーの額（（イ） + （ロ） + （ハ） + （ニ））（ヘ）	170,502,605	175,798,445
22		連結レバレッジ比率（（ホ） / （ヘ））	5.32%	5.14%
日本銀行に対する預け金を算入する場合の連結レバレッジ比率（6）				
		総エクスポージャーの額（ヘ）	170,502,605	175,798,445
		日本銀行に対する預け金の額	57,715,290	52,759,931
		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´）	228,217,896	228,558,377
		日本銀行に対する預け金を算入する場合の連結レバレッジ比率（（ホ） / （ヘ´））	3.98%	3.96%