

持株レバレッジ比率の構成に関する事項

株式会社三井住友フィナンシャルグループ（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 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	145,200,251	189,089,655
1a	1	連結貸借対照表における総資産の額	172,382,863	219,863,518
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（△）	27,182,612	30,773,863
2	7	Tier1資本に係る調整項目の額（△）	900,233	878,104
3		オン・バランス資産の額（イ）	144,300,018	188,211,550
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	4,268,048	6,878,993
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	3,840,357	4,556,886
		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	855,195	923,702
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（△）	113,232	151,482
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	964,578	900,439
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（△）	867,925	744,710
11	4	デリバティブ取引等に関する額（ロ）	8,947,022	12,363,828
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	10,932,594	13,758,920
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	393,094	459,828
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）	11,325,688	14,218,749
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	65,696,391	61,636,792
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（△）	41,208,039	38,942,263
19	6	オフ・バランス取引に関する額（ニ）	24,488,351	22,694,529
持株レバレッジ比率（5）				
20		資本の額（ホ）	10,530,749	10,249,936
21	8	総エクスポージャーの額（（イ） + （ロ） + （ハ） + （ニ））（ヘ）	189,061,080	237,488,658
22		持株レバレッジ比率（（ホ） / （ヘ））	5.57%	4.31%
日本銀行に対する預け金を算入する場合の持株レバレッジ比率（6）				
		総エクスポージャーの額（ヘ）	189,061,080	
		日本銀行に対する預け金の額	53,764,626	
		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´）	242,825,707	
		日本銀行に対する預け金を算入する場合の持株レバレッジ比率（（ホ） / （ヘ´））	4.33%	

（注）2020年3月末の持株レバレッジ比率との間に著しい差異を生じた要因

持株レバレッジ比率の上昇は、平成31年金融庁告示第12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