

VII. 連結レバレッジ比率に関する開示事項

連結レバレッジ比率の構成に関する事項

(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	平成27年9月30日	平成28年9月30日
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	7,374,916	8,226,334
1a	1	中間連結貸借対照表における総資産の額	7,421,361	8,277,966
1b	2	連結レバレッジ比率又は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	連結レバレッジ比率又は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(中間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	中間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(△)	46,445	51,632
2	7	Tier1 資本に係る調整項目の額(△)	6,348	9,672
3		オン・バランス資産の額 (イ)	7,368,568	8,216,661
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再構築コストの額	13,159	16,066
5		デリバティブ取引等に関するアドオンの額	40,747	44,671
6		デリバティブ取引等に関連して現金で差入れた証拠金の対価の額 中間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入れた変動証拠金の対価の額のうち控除する額(△)	—	—
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	—	—
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)	53,907	60,738
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	—	—
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	5,970	10,389
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)	5,970	10,389
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	1,485,635	1,534,661
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(△)	1,262,319	1,311,053
19	6	オフ・バランス取引に関する額 (ニ)	223,316	223,607
連結レバレッジ比率又は持株レバレッジ比率 (5)				
20		資本の額 (ホ)	447,374	481,565
21	8	総エクスポージャーの額((イ) + (ロ) + (ハ) + (ニ)) (ヘ)	7,651,762	8,511,396
22		連結レバレッジ比率又は持株レバレッジ比率((ホ) / (ヘ))	5.84%	5.65%

(注記事項)

「国際様式の該当番号」とは、パーゼル銀行監督委員会により平成26年1月12日に公表されたレバレッジ比率の枠組みと開示要件と題する文書の表1及び表2に記載された番号を指します。