

レバレッジ比率の構成に関する事項

[連結:2020年9月末]

(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	7,926,437	8,048,870
	1a	1 連結貸借対照表における総資産の額	7,972,913	8,091,602
	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 ()	46,476	42,732
2	7	Tier1 資本に係る調整項目の額 ()	12,233	13,843
3		オン・バランス資産の額 (イ)	7,914,203	8,035,026
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	12,173	9,101
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	50,209	44,120
		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	-	-
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 ()	-	-
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)	62,382	53,222
レボ取引等に関する額 (3)				
12		レボ取引等に関する資産の額	-	-
13		レボ取引等に関する資産の額から控除した額 ()	-	-
14		レボ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	5,567	3,117
15		代理取引のエクスポージャーの額	-	-
16	5	レボ取引等に関する額 (ハ)	5,567	3,117
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	1,668,723	1,653,582
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 ()	1,437,372	1,417,937
19	6	オフ・バランス取引に関する額 (ニ)	231,351	235,644
連結レバレッジ比率 (5)				
20		資本の額 (ホ)	526,298	518,624
21	8	総エクスポージャーの額((イ)+(ロ)+(ハ)+(ニ)) (ヘ)	8,213,506	8,327,010
22		連結レバレッジ比率((ホ)/(ヘ))	6.40%	6.22%
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)	8,213,506	8,327,010
		日本銀行に対する預け金の額	799,788	630,939
		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')	9,013,294	8,957,949
		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'))	5.83%	5.78%

レバレッジ比率の構成に関する事項

[単体:2020年9月末]

(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	7,895,492	8,018,039
	1a	1 貸借対照表における総資産の額	7,941,968	8,060,771
	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 ()	46,476	42,732
2	7	Tier1 資本に係る調整項目の額 ()	14,266	15,942
3		オン・バランス資産の額 (イ)	7,881,225	8,002,096
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	12,173	9,101
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	50,209	44,120
		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	-	-
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 ()	-	-
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)	62,382	53,222
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	5,567	3,117
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)	5,567	3,117
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	1,663,191	1,648,088
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 ()	1,432,402	1,413,001
19	6	オフ・バランス取引に関する額 (ニ)	230,789	235,087
単体レバレッジ比率 (5)				
20		資本の額 (ホ)	508,033	500,896
21	8	総エクスポージャーの額((イ)+(ロ)+(ハ)+(ニ)) (ヘ)	8,179,965	8,293,523
22		単体レバレッジ比率((ホ)/(ヘ))	6.21%	6.03%
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)	8,179,965	8,293,523
		日本銀行に対する預け金の額	799,788	630,939
		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')	8,979,754	8,924,462
		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'))	5.65%	5.61%