

連結レバレッジ比率の構成に関する事項
2020年6月末

(単位:百万円、%)

国際様式(表2) の該当番号(注)	国際様式(表1) の該当番号(注)	項目	当四半期末	前四半期末
オン・バランス資産の額				
1		調整項目控除前のオン・バランス資産の額	11,754,918	12,463,178
1a	1	連結貸借対照表における総資産の額	13,226,661	12,542,772
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(△)	1,471,743	79,594
2	7	Tier1 資本に係る調整項目の額(△)	51,368	49,882
3		オン・バランス資産の額 (イ)	11,703,550	12,413,296
デリバティブ取引等に関する額				
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	40,003	36,358
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	66,898	60,084
		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	1,176	1,625
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	3,000	3,000
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)	111,078	101,068
レボ取引等に関する額				
12		レボ取引等に関する資産の額	69,773	-
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	14,856	17,632
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)	84,630	17,632
オフ・バランス取引に関する額				
17		オフ・バランス取引の想定元本の額	1,190,062	1,145,120
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(△)	967,272	930,795
19	6	オフ・バランス取引に関する額 (ニ)	222,789	214,325
連結レバレッジ比率				
20		資本の額 (ホ)	920,788	893,793
21	8	総エクスポージャーの額((イ)+(ロ)+(ハ)+(ニ)) (ヘ)	12,122,049	12,746,322
22		連結レバレッジ比率 ((ホ)/(ヘ))	7.59%	7.01%
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				
		総エクスポージャーの額 (ヘ)	12,122,049	
		日本銀行に対する預け金の額	1,331,774	
		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')	13,453,823	
		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'))	6.84%	

(注)「国際様式の該当番号」とは、バーゼル銀行監督委員会により2014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 に記載された番号です。

前四半期の連結レバレッジ比率との間に著しい差異を生じた原因

2019年金融庁告示第11号において、2020年6月29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。

単体レバレッジ比率の構成に関する事項
2020年6月末

(単位:百万円、%)

国際様式(表2) の該当番号(注)	国際様式(表1) の該当番号(注)	項目	当四半期末	前四半期末
オン・バランス資産の額				
1		調整項目控除前のオン・バランス資産の額	11,686,847	12,398,545
1a	1	貸借対照表における総資産の額	13,204,611	12,505,670
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(△)	1,517,763	107,124
2	7	Tier1 資本に係る調整項目の額(△)	56,879	55,021
3		オン・バランス資産の額 (イ)	11,629,968	12,343,523
デリバティブ取引等に関する額				
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	40,008	36,361
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	66,906	60,087
		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	1,176	1,571
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	3,000	3,000
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)	111,092	101,019
レボ取引等に関する額				
12		レボ取引等に関する資産の額	69,773	-
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	14,379	17,194
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)	84,152	17,194
オフ・バランス取引に関する額				
17		オフ・バランス取引の想定元本の額	1,264,057	1,183,452
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(△)	988,384	936,171
19	6	オフ・バランス取引に関する額 (ニ)	275,673	247,281
単体レバレッジ比率				
20		資本の額 (ホ)	847,567	821,132
21	8	総エクスポージャーの額((イ)+(ロ)+(ハ)+(ニ)) (ヘ)	12,100,887	12,709,019
22		単体レバレッジ比率 ((ホ)/(ヘ))	7.00%	6.46%
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				
		総エクスポージャーの額 (ヘ)	12,100,887	
		日本銀行に対する預け金の額	1,331,774	
		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')	13,432,662	
		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'))	6.30%	

(注)「国際様式の該当番号」とは、バーゼル銀行監督委員会により2014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に記載された番号です。

前四半期の単体レバレッジ比率との間に著しい差異を生じた原因

2019年金融庁告示第11号において、2020年6月29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。