

連結レバレッジ比率の構成に関する事項
2020年9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	11,633,139	11,754,918
1a	1	連結貸借対照表における総資産の額	13,240,715	13,226,661
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(△)	1,607,576	1,471,743
2	7	Tier1 資本に係る調整項目の額(△)	53,351	51,368
3		オン・バランス資産の額 (イ)	11,579,787	11,703,550
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	38,159	40,003
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	66,260	66,898
		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	938	1,176
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)	108,357	111,078
レポ取引等に関する額				
12		レポ取引等に関する資産の額	-	69,773
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	9,011	14,856
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)	9,011	84,630
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	1,214,542	1,190,062
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(△)	985,791	967,272
19	6	オフ・バランス取引に関する額 (ニ)	228,751	222,789
連結レバレッジ比率				
20		資本の額 (ホ)	942,096	920,788
21	8	総エクスポージャーの額((イ)+(ロ)+(ハ)+(ニ)) (ヘ)	11,925,908	12,122,049
22		連結レバレッジ比率 ((ホ)/(ヘ))	7.89%	7.59%
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)	11,925,908	12,122,049
		日本銀行に対する預け金の額	1,537,822	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')	13,463,730	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'))	6.99%	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。

単体レバレッジ比率の構成に関する事項
2020年9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	11,569,681	11,686,847
1a	1	貸借対照表における総資産の額	13,219,043	13,204,611
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(△)	1,649,361	1,517,763
2	7	Tier1 資本に係る調整項目の額(△)	58,536	56,879
3		オン・バランス資産の額 (イ)	11,511,145	11,629,968
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	38,159	40,008
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	66,268	66,906
		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	938	1,176
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)	108,366	111,092
レポ取引等に関する額				
12		レポ取引等に関する資産の額	-	69,773
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	9,011	14,379
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)	9,011	84,152
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	1,284,088	1,264,057
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(△)	1,006,793	988,384
19	6	オフ・バランス取引に関する額 (ニ)	277,295	275,673
単体レバレッジ比率				
20		資本の額 (ホ)	868,029	847,567
21	8	総エクスポージャーの額((イ)+(ロ)+(ハ)+(ニ)) (ヘ)	11,905,818	12,100,887
22		単体レバレッジ比率 ((ホ)/(ヘ))	7.29%	7.00%
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)	11,905,818	12,100,887
		日本銀行に対する預け金の額	1,537,822	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')	13,443,641	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'))	6.45%	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。