

レバレッジ比率の構成に関する事項
(2019年12月期)

1. 連結レバレッジ比率(平成26年金融庁告示第7号、別紙様式第六号)

(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(2019年12月期)	前四半期末(2019年9月期)
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	10,691,738	10,639,711
	1a	1 連結貸借対照表における総資産の額	10,767,239	10,730,645
	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(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(△)	75,500	90,934
	2	7 Tier1資本に係る調整項目の額(△)	33,995	31,229
	3	オン・バランス資産の額(イ)	10,657,742	10,608,482
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	11,719	17,284
	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	27,952	30,125
		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	32,825	46,339
	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)	72,497	93,749
レポ取引等に関する額				
	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	218,582	265,234
	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)	218,582	265,234
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	2,093,221	2,132,679
	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(△)	1,814,194	1,847,299
	19	6 オフ・バランス取引に関する額(ニ)	279,027	285,380
連結レバレッジ比率又は持株レバレッジ比率				
	20	資本の額(ホ)	735,206	724,882
	21	8 総エクスポージャーの額((イ)+(ロ)+(ハ)+(ニ))(ヘ)	11,227,850	11,252,846
	22	連結レバレッジ比率又は持株レバレッジ比率(ホ)÷(ヘ)	6.54	6.44

(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。

2. 単体レバレッジ比率 (平成26年金融庁告示第7号、別紙様式第三号)

(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 (2019年12月期)	前四半期末 (2019年9月期)
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	10,629,447	10,581,722
1a	1	貸借対照表における総資産の額	10,704,948	10,672,656
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(△)	75,500	90,934
2	7	Tier1資本に係る調整項目の額(△)	34,624	31,610
3		オン・バランス資産の額(イ)	10,594,823	10,550,111
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	11,719	17,284
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	27,952	30,125
		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	32,825	46,339
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)	72,497	93,749
レポ取引等に関する額				
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	218,582	265,234
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)	218,582	265,234
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	2,065,449	2,103,812
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(△)	1,789,214	1,821,336
19	6	オフ・バランス取引に関する額(ニ)	276,234	282,476
単体レバレッジ比率				
20		資本の額(ホ)	695,106	685,893
21	8	総エクスポージャーの額((イ)+(ロ)+(ハ)+(ニ))(ヘ)	11,162,138	11,191,572
22		単体レバレッジ比率((ホ)/(ヘ))	6.22	6.12

(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。