

レバレッジ比率の構成に関する事項  
(2020年6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 (2020年6月期)	前四半期末 (2020年3月期)
<b>オン・バランス資産の額</b>				
1		調整項目控除前のオン・バランス資産の額	9,206,880	10,367,254
1a	1	連結貸借対照表における総資産の額	9,301,940	10,470,547
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(Δ)	—	—
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(Δ)	95,060	103,292
2	7	Tier1資本に係る調整項目の額(Δ)	30,287	34,761
3		オン・バランス資産の額(イ)	9,176,592	10,332,492
<b>デリバティブ取引等に関する額</b>				
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	14,080	20,360
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	32,967	33,219
		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	56,177	58,314
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(Δ)	—	—
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(Δ)	—	—
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(Δ)	—	—
11	4	デリバティブ取引等に関する額(ロ)	103,226	111,894
<b>レボ取引等に関する額</b>				
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(Δ)	—	—
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	220,659	250,037
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)	220,659	250,037
<b>オフ・バランス取引に関する額</b>				
17		オフ・バランス取引の想定元本の額	2,114,146	2,125,837
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(Δ)	1,830,859	1,835,413
19	6	オフ・バランス取引に関する額(ニ)	283,287	290,424
<b>連結レバレッジ比率又は持株レバレッジ比率</b>				
20		資本の額(ホ)	738,002	683,222
21	8	総エクスポージャーの額((イ)+(ロ)+(ハ)+(ニ))(ヘ)	9,783,765	10,984,849
22		連結レバレッジ比率又は持株レバレッジ比率((ホ)÷(ヘ))	7.54	6.21
<b>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又は持株レバレッジ比率</b>				
		総エクスポージャーの額(ヘ)	9,783,765	—
		日本銀行に対する預け金の額	1,970,354	—
		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)	11,754,120	—
		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又は持株レバレッジ比率((ホ)÷(ヘ))	6.27	—

(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 (2020年6月期)	前四半期末 (2020年3月期)
<b>オン・バランス資産の額</b>				
1		調整項目控除前のオン・バランス資産の額	9,152,072	10,309,915
	1a	1 貸借対照表における総資産の額	9,247,132	10,413,208
	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(Δ)	95,060	103,292
2	7	Tier1 資本に係る調整項目の額(Δ)	33,395	37,631
3		オン・バランス資産の額(イ)	9,118,677	10,272,283
<b>デリバティブ取引等に関する額</b>				
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	14,080	20,360
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	32,967	33,219
		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	56,177	58,314
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(Δ)	—	—
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(Δ)	—	—
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(Δ)	—	—
11	4	デリバティブ取引等に関する額(ロ)	103,226	111,894
<b>レボ取引等に関する額</b>				
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(Δ)	—	—
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	220,659	250,037
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)	220,659	250,037
<b>オフ・バランス取引に関する額</b>				
17		オフ・バランス取引の想定元本の額	2,086,887	2,098,114
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(Δ)	1,806,340	1,810,476
19	6	オフ・バランス取引に関する額(ニ)	280,547	287,637
<b>単体レバレッジ比率</b>				
20		資本の額(ホ)	675,587	626,668
21	8	総エクスポージャーの額((イ)+(ロ)+(ハ)+(三))(ヘ)	9,723,109	10,921,853
22		単体レバレッジ比率((ホ)/(ヘ))	6.94	5.73
<b>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</b>				
		総エクスポージャーの額(ヘ)	9,723,109	—
		日本銀行に対する預け金の額	1,970,354	—
		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)	11,693,464	—
		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))	5.77	—

(注)「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。