

レバレッジ比率の構成に関する事項
(2020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 (2020年12月期)	前四半期末 (2020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	9,369,624	9,125,305
1a	1	連結貸借対照表における総資産の額	9,456,927	9,215,675
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)	87,302	90,370
2	7	Tier1資本に係る調整項目の額(Δ)	31,528	29,676
3		オン・バランス資産の額(イ)	9,338,096	9,095,629
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	18,010	14,267
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	37,762	36,406
		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	45,037	51,839
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)	100,811	102,513
レボ取引等に関する額				
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	262,673	229,266
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)	262,673	229,266
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	2,189,947	2,193,681
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)	1,888,425	1,893,574
19	6	オフ・バランス取引に関する額(ニ)	301,521	300,107
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)	826,430	765,675
21	8	総エクスポージャーの額((イ)+(ロ)+(ハ)+(ニ))(ヘ)	10,003,102	9,727,516
22		連結レバレッジ比率又は持株レバレッジ比率((ホ)÷(ヘ))	8.26	7.87
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				
		総エクスポージャーの額(ヘ)	10,003,102	9,727,516
		日本銀行に対する預け金の額	2,136,573	2,109,506
		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)	12,139,676	11,837,023
		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))	6.80	6.46

(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12月期)	前四半期末 (2020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	9,310,134	9,069,014
1a	1	貸借対照表における総資産の額	9,397,436	9,159,384
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)	87,302	90,370
2	7	Tier1資本に係る調整項目の額(Δ)	34,545	32,661
3		オン・バランス資産の額(イ)	9,275,588	9,036,352
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	18,010	14,267
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	37,762	36,406
		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	45,037	51,839
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)	100,811	102,513
レボ取引等に関する額				
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	262,673	229,266
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)	262,673	229,266
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	2,167,638	2,170,234
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)	1,868,370	1,872,494
19	6	オフ・バランス取引に関する額(ニ)	299,268	297,739
単体レバレッジ比率				
20		資本の額(ホ)	761,371	702,198
21	8	総エクスポージャーの額((イ)+(ロ)+(ハ)+(三))(ヘ)	9,938,341	9,665,873
22		単体レバレッジ比率((ホ)/(ヘ))	7.66	7.26
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)	9,938,341	9,665,873
		日本銀行に対する預け金の額	2,136,573	2,109,506
		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)	12,074,914	11,775,379
		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	5.96

(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。