

レバレッジ比率の構成に関する事項
(2021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 (2021年12月期)	前四半期末 (2021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	9,583,659	9,467,693
1a	1	連結貸借対照表における総資産の額	9,672,086	9,559,502
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(△)	88,427	91,809
2	7	Tier1資本に係る調整項目の額(△)	51,577	51,966
3		オン・バランス資産の額(イ)	9,532,081	9,415,726
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	20,868	20,166
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	38,889	38,329
		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	42,092	47,193
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)	101,850	105,689
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(△)	—	—
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	315,331	326,389
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)	315,331	326,389
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	2,047,804	2,069,909
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(△)	1,751,286	1,771,908
19	6	オフ・バランス取引に関する額(ニ)	296,518	298,000
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)	869,816	851,021
21	8	総エクスポージャーの額((イ)+(ロ)+(ハ)+(ニ))(ヘ)	10,245,781	10,145,806
22		連結レバレッジ比率又は持株レバレッジ比率((ホ)/(ヘ))	8.48	8.38
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)	10,245,781	10,145,806
		日本銀行に対する預け金の額	4,250,010	3,670,244
		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')	14,495,792	13,816,051
		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'))	6.00	6.15

(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 (2021年12月期)	前四半期末 (2021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	9,505,233	9,385,045
	1a	1 貸借対照表における総資産の額	9,593,660	9,476,855
	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(△)	88,427	91,809
2	7	Tier1資本に係る調整項目の額(△)	41,088	41,062
3		オン・バランス資産の額(イ)	9,464,144	9,343,983
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	20,868	20,166
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	38,889	38,329
		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	42,092	47,193
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)	101,850	105,689
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	315,331	326,389
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)	315,331	326,389
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	2,031,197	2,049,341
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(△)	1,736,357	1,753,416
19	6	オフ・バランス取引に関する額(ニ)	294,840	295,925
単体レバレッジ比率				
20		資本の額(ホ)	798,736	781,441
21	8	総エクスポージャーの額((イ)+(ロ)+(ハ)+(ニ))(ヘ)	10,176,166	10,071,988
22		単体レバレッジ比率((ホ)/(ヘ))	7.84	7.75
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)	10,176,166	10,071,988
		日本銀行に対する預け金の額	4,250,010	3,670,244
		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)	14,426,177	13,742,233
		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))	5.53	5.68

(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。