

レバレッジ比率の構成に関する事項
(2023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(2023年12月期)	前四半期末(2023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	10,983,549	10,796,171
1a	1	連結貸借対照表における総資産の額	11,099,617	10,936,833
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(△)	116,068	140,662
2	7	Tier1資本に係る調整項目の額(△)	62,208	73,344
3		オン・バランス資産の額(イ)	10,921,341	10,722,826
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	61,211	54,146
		デリバティブ取引等に関する再構築コストの額	—	—
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	31,476	30,846
		デリバティブ取引等に関するアドオンの額	—	—
		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	—	—
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(△)	9,580	22,322
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	30,226	30,505
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)	113,332	93,175
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	195,126	162,590
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)	195,126	162,590
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	2,121,443	2,147,115
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(△)	1,776,772	1,796,362
19	6	オフ・バランス取引に関する額(ニ)	344,671	350,753
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)	945,784	844,629
21	8	総エクスポージャーの額((イ)+(ロ)+(ハ)+(ニ))(ヘ)	11,574,472	11,329,346
22		連結レバレッジ比率又は持株レバレッジ比率((ホ)/(ヘ))	8.17	7.45
		適用する所要連結レバレッジ比率又は所要持株レバレッジ比率	3.00	3.00
		適用する所要連結レバレッジ・バッファ率又は所要持株レバレッジ・バッファ率	—	—
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)	11,574,472	11,329,346
		日本銀行に対する預け金の額	3,511,395	3,731,744
		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)	15,085,867	15,061,090
		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))	6.26	5.60

(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. 前四半期の連結レバレッジ比率との間に著しい差異を生じた原因

「その他の包括利益累計額及びその他公表準備金の額」の増加を主に、資本の額が増加したためです。

3. 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 (2023年12月期)	前四半期末 (2023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	9,859,030	9,667,063
1a	1	貸借対照表における総資産の額	9,973,745	9,806,382
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(△)	114,715	139,319
2	7	Tier1 資本に係る調整項目の額(△)	53,532	61,765
3		オン・バランス資産の額(イ)	9,805,498	9,605,298
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	61,210	54,145
		デリバティブ取引等に関する再構築コストの額	—	—
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	28,913	27,983
		デリバティブ取引等に関するアドオンの額	—	—
		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	—	—
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(△)	9,580	22,322
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)	80,543	59,806
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	195,126	162,590
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)	195,126	162,590
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	2,043,055	2,065,632
18		オフ・バランス取引に係るエクスポージャーの額への交換調整の額(△)	1,707,623	1,732,949
19	6	オフ・バランス取引に関する額(ニ)	335,432	332,683
単体レバレッジ比率				
20		資本の額(ホ)	858,842	764,388
21	8	総エクスポージャーの額((イ)+(ロ)+(ハ)+(ニ))(ヘ)	10,416,600	10,160,378
22		単体レバレッジ比率((ホ)/(ヘ))	8.24	7.52
		適用する所要単体レバレッジ比率	3.00	3.00
		適用する所要単体レバレッジ・バッファ率	—	—
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)	10,416,600	10,160,378
		日本銀行に対する預け金の額	3,468,485	3,680,825
		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')	13,885,085	13,841,204
		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'))	6.18	5.52

(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。

4. 前四半期の単体レバレッジ比率との間に著しい差異を生じた原因

「評価・換算差額等及びその他公表準備金の額」の増加を主に、資本の額が増加したためです。