

レバレッジ比率の構成に関する事項  
(2024年3月期)

1. 連結レバレッジ比率 (別紙様式第六号)

(単位: 百万円、%)

【第一面】

国際様式 (LR1) の該当番号 (注)	項目	当四半期末 (2024年3月期)	前四半期末 (2023年12月期)
1	連結貸借対照表における総資産の額	14,827,752	
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(△)	—	
3	リスク移転の認識に係る要件を充足しない証券化エクスポージャーに係る調整	—	
4	中央銀行預け金に係る除外による調整(△)	3,574,514	
5	顧客資産のうち、連結貸借対照表に計上されている金額(△)	—	
6	有価証券の売買を約定日基準により会計処理している場合における調整項目	—	
7	キャッシュ・プーリング契約に基づく資金の移動に係る調整項目	—	
8	デリバティブ取引等に関する調整額	10,161	
8a	デリバティブ取引等に関する額	83,851	
8b	デリバティブ取引等に関連する資産の額(△)	73,690	
9	レポ取引等に関する調整額	181,424	
9a	レポ取引等に関する額	181,424	
9b	レポ取引等に関する額(△)	—	
10	オフ・バランス取引に関する額	185,454	
11	Tier1資本に係る調整項目の額(貸倒引当金)(△)	3,647	
12	その他の調整項目	△ 153,446	
12a	Tier1資本に係る調整項目の額(貸倒引当金以外)(△)	76,810	
12b	支払承諾見返勘定の額(△)	53,936	
12c	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(相殺した額に相当する部分に限る)	—	
12d	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(△)	22,700	
12e	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法人等の資産の額(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)	—	
13	総エクスポージャーの額	11,473,184	

(注) 「国際様式 (LR1) の該当番号」とは、パーゼル銀行監督委員会により2019年12月15日公表された「Consolidated framework.DIS80 Leverage ratio」と題する文書の表LR1に記載された番号です。

【第二面】

国際様式 (LR2) の該当番号	項目	当四半期末 (2024年3月期)	前四半期末 (2023年12月期)
<b>オン・バランス資産の額(1)</b>			
1	個別項目調整前のオン・バランス資産の額	11,125,610	
2	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(相殺した額に相当する部分に限る)	—	
3	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(△)	22,700	
4	レボ取引等により受領した証券の計上額(△)	—	
5	Tier1資本に係る調整項目の額(貸倒引当金)(△)	3,647	
6	Tier1資本に係る調整項目の額(貸倒引当金以外)(△)	76,810	
7	オン・バランス資産の額(イ)	11,022,453	
<b>デリバティブ取引等に関する額(2)</b>			
8	デリバティブ取引等に関するRCの額に1.4を乗じた額	54,496	
9	デリバティブ取引等に関するPFEの額に1.4を乗じた額	29,355	
10	間接清算参加者に適格中央清算機関の債務履行を保証していない場合に零とした中央清算機関向けエクスポージャーの額(△)	—	
11	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	—	
12	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(△)	—	
13	デリバティブ取引等に関する額(ロ)	83,851	
<b>レボ取引等に関する額(3)</b>			
14	レボ取引等に関する資産の額	—	
15	レボ取引等に関する資産の額から控除した額(△)	—	
16	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	181,424	
17	代理取引のエクスポージャーの額	—	
18	レボ取引等に関する額(ハ)	181,424	
<b>オフ・バランス取引に関する額(4)</b>			
19	オフ・バランス取引の想定元本の額	2,146,813	
20	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(△)	1,961,358	
22	オフ・バランス取引に関する額(ニ)	185,454	
<b>連結レバレッジ比率又は持株レバレッジ比率(5)</b>			
23	資本の額(ホ)	1,010,952	
24	総エクスポージャーの額((イ)+(ロ)+(ハ)+(ニ))(ヘ)	11,473,184	
25	連結レバレッジ比率又は持株レバレッジ比率((ホ)/(ヘ))	8.81	
26	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	
27	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		
<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(6)</b>			
	総エクスポージャーの額(ヘ)	11,473,184	
	日本銀行に対する預け金の額	3,574,514	
	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')	15,047,698	
	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'))	6.71	
<b>平均値の開示(7)</b>			
28	レボ取引等に関する資産の額(控除後)に係る平均値(ト)+(チ)	—	
	レボ取引等に関する資産の額に係る平均値(ト)	—	
	レボ取引等に関する資産の額から控除した額に係る平均値(△)(チ)	—	
29	レボ取引等に関する資産の額(控除後)に係る四半期末の値(リ)+(ヌ)	—	
14	レボ取引等に関する資産の額に係る四半期末の値(リ)	—	
15	レボ取引等に関する資産の額から控除した額に係る四半期末の値(△)(ヌ)	—	
30	総エクスポージャーの額(ル) (レボ取引等に関する資産の額(控除後)に係る平均値を使用し、日本銀行に対する預け金を算入しない場合)	11,473,184	
30a	総エクスポージャーの額(ヲ) (レボ取引等に関する資産の額(控除後)に係る平均値を使用し、日本銀行に対する預け金を算入する場合)	15,047,698	
31	連結レバレッジ比率又は持株レバレッジ比率((ホ)/(ル)) (レボ取引等に関する資産の額(控除後)に係る平均値を使用し、日本銀行に対する預け金を算入しない場合)	8.81	
32	連結レバレッジ比率又は持株レバレッジ比率((ホ)/(ヲ)) (レボ取引等に関する資産の額(控除後)に係る平均値を使用し、日本銀行に対する預け金を算入する場合)	6.71	

(注)「国際様式(LR2)の該当番号」とは、バーゼル銀行監督委員会により2019年12月15日公表された「Consolidated framework.DIS80 Leverage ratio」と題する文書の表LR2に記載された番号です。

(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 (2024年3月期)	前四半期末 (2023年12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		10,983,549
1a	1	連結貸借対照表における総資産の額		11,099,617
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
2	7	Tier1資本に係る調整項目の額(△)		62,208
3		オン・バランス資産の額(イ)		10,921,341
<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		61,211
		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
		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
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
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
<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(△)		—
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
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
<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		2,121,443
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
19	6	オフ・バランス取引に関する額(ニ)		344,671
<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)		945,784
21	8	総エクスポージャーの額((イ)+(ロ)+(ハ)+(ニ))(ヘ)		11,574,472
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
		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
		適用する所要連結レバレッジ・バッファ比率又は所要持株レバレッジ・バッファ比率		—
<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)		11,574,472
		日本銀行に対する預け金の額		3,511,395
		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
		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

(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」の増加を主因に、資本の額が増加したためです。

3. 単体レバレッジ比率 (別紙様式第三号)

(単位: 百万円、%)

【第一面】

国際様式(LR1)の該当番号 (注)	項目	当四半期末 (2024年3月期)	前四半期末 (2023年12月期)
1	貸借対照表における総資産の額	13,711,395	
3	リスク移転の認識に係る要件を充足しない証券化エクスポージャーに係る調整	—	
4	中央銀行預け金に係る除外による調整(△)	3,541,126	
5	顧客資産のうち、貸借対照表に計上されている金額(△)		
6	有価証券の売買を約定日基準により会計処理している場合における調整項目	—	
7	キャッシュ・フロー契約に基づく資金の移動に係る調整項目	—	
8	デリバティブ取引等に関する調整額	10,161	
8a	デリバティブ取引等に関する額	83,851	
8b	デリバティブ取引等に関連する資産の額(△)	73,690	
9	レボ取引等に関する調整額	181,424	
9a	レボ取引等に関する額	181,424	
9b	レボ取引等に関する額(△)	—	
10	オフ・バランス取引に関する額	184,451	
11	Tier1資本に係る調整項目の額(貸倒引当金)(△)	5,272	
12	その他の調整項目	△ 127,190	
12a	Tier1資本に係る調整項目の額(貸倒引当金以外)(△)	51,777	
12b	支払承諾見返勘定の額(△)	52,713	
12c	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(相殺した額に相当する部分に限る)	—	
12d	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(△)	22,700	
13	総エクスポージャーの額	10,413,843	

(注) 「国際様式(LR1)の該当番号」とは、パーゼル銀行監督委員会により2019年12月15日公表された「Consolidated framework.DIS80 Leverage ratio」と題する文書の表LR1に記載された番号です。

【第二面】

国際様式 (LR2) の該当番号	項目	当四半期末 (2024年3月期)	前四半期末 (2023年12月期)
<b>オン・バランス資産の額(1)</b>			
1	個別項目調整前のオン・バランス資産の額	10,043,864	
2	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(相殺した額に相当する部分に限る)	—	
3	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(△)	22,700	
4	レボ取引等により受領した証券の計上額(△)	—	
5	Tier1資本に係る調整項目の額(貸倒引当金)(△)	5,272	
6	Tier1資本に係る調整項目の額(貸倒引当金以外)(△)	51,777	
7	オン・バランス資産の額(イ)	9,964,115	
<b>デリバティブ取引等に関する額(2)</b>			
8	デリバティブ取引等に関するRCの額に1.4を乗じた額	54,496	
9	デリバティブ取引等に関するPFEの額に1.4を乗じた額	29,355	
10	間接清算参加者に適格中央清算機関の債務履行を保証していない場合に零とした中央清算機関向けエクスポージャーの額(△)	—	
11	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	—	
12	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(△)	—	
13	デリバティブ取引等に関する額(ロ)	83,851	
<b>レボ取引等に関する額(3)</b>			
14	レボ取引等に関する資産の額	—	
15	レボ取引等に関する資産の額から控除した額(△)	—	
16	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	181,424	
17	代理取引のエクスポージャーの額	—	
18	レボ取引等に関する額(ハ)	181,424	
<b>オフ・バランス取引に関する額(4)</b>			
19	オフ・バランス取引の想定元本の額	2,118,208	
20	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(△)	1,933,756	
22	オフ・バランス取引に関する額(ニ)	184,451	
<b>連結レバレッジ比率又は持株レバレッジ比率(5)</b>			
23	資本の額(ホ)	922,045	
24	総エクスポージャーの額((イ)+(ロ)+(ハ)+(ニ))(ヘ)	10,413,843	
25	単体レバレッジ比率(ホ)/(ヘ)	8.85	
26	適用する所要単体レバレッジ比率	3.00	
27	適用する所要単体レバレッジ・バッファ比率	—	
<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(6)</b>			
	総エクスポージャーの額(ヘ)	10,413,843	
	日本銀行に対する預け金の額	3,541,126	
	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')	13,954,970	
	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'))	6.60	
<b>平均値の開示(7)</b>			
28	レボ取引等に関する資産の額(控除後)に係る平均値((ト)+(チ))	—	
	レボ取引等に関する資産の額に係る平均値(ト)	—	
	レボ取引等に関する資産の額から控除した額に係る平均値(△)(チ)	—	
29	レボ取引等に関する資産の額(控除後)に係る四半期末の値((リ)+(ヌ))	—	
14	レボ取引等に関する資産の額に係る四半期末の値(リ)	—	
15	レボ取引等に関する資産の額から控除した額に係る四半期末の値(△)(ヌ)	—	
30	総エクスポージャーの額(ル) (レボ取引等に関する資産の額(控除後)に係る平均値を使用し、日本銀行に対する預け金を算入しない場合)	10,413,843	
30a	総エクスポージャーの額(ヲ) (レボ取引等に関する資産の額(控除後)に係る平均値を使用し、日本銀行に対する預け金を算入する場合)	13,954,970	
31	単体レバレッジ比率(ホ)/(ル) (レボ取引等に関する資産の額(控除後)に係る平均値を使用し、日本銀行に対する預け金を算入しない場合)	8.85	
32	単体レバレッジ比率又(ホ)/(ヲ) (レボ取引等に関する資産の額(控除後)に係る平均値を使用し、日本銀行に対する預け金を算入する場合)	6.60	

(注)「国際様式(LR2)の該当番号」とは、バーゼル銀行監督委員会により2019年12月15日公表された「Consolidated framework.DIS80 Leverage ratio」と題する文書の表LR2に記載された番号です

(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 (2024年3月期)	前四半期末 (2023年12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		9,859,030
	1a	1 貸借対照表における総資産の額		9,973,745
	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)		114,715
2	7	Tier1資本に係る調整項目の額(Δ)		53,532
3		オン・バランス資産の額(イ)		9,805,498
<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		61,210
		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
		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(Δ)		9,580
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)		80,543
<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		195,126
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
<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		2,043,055
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)		1,707,623
19	6	オフ・バランス取引に関する額(ニ)		335,432
<b>単体レバレッジ比率</b>				
20		資本の額(ホ)		858,842
21	8	総エクスポージャーの額((イ)+(ロ)+(ハ)+(ニ))(ヘ)		10,416,600
22		単体レバレッジ比率(ホ)／(ヘ)		8.24
		適用する所要単体レバレッジ比率		3.00
		適用する所要単体レバレッジ・バッファ率		—
<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)		10,416,600
		日本銀行に対する預け金の額		3,468,485
		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
		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

(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」の増加を主因に、資本の額が増加したためです。