

レバレッジ比率の構成に関する事項
(2024年6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6月期)	前四半期末 (2024年3月期)
1	連結貸借対照表における総資産の額	14,859,145	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(△)	3,628,308	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	1,988	10,161
8a	デリバティブ取引等に関する額	97,698	83,851
8b	デリバティブ取引等に関連する資産の額(△)	95,710	73,690
9	レポ取引等に関する調整額	174,742	181,424
9a	レポ取引等に関する額	174,742	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	189,522	185,454
11	Tier1資本に係る調整項目の額(貸倒引当金)(△)	3,195	3,647
12	その他の調整項目	△ 169,417	△ 153,446
12a	Tier1資本に係る調整項目の額(貸倒引当金以外)(△)	87,570	76,810
12b	支払承諾見返勘定の額(△)	54,200	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(△)	27,647	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	11,424,477	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(注)	項目	当四半期末 (2024年6月期)	前四半期末 (2024年3月期)
オン・バランス資産の額(1)			
1	個別項目調整前のオン・バランス資産の額	11,080,927	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(△)	27,647	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)(△)	3,195	3,647
6	Tier1資本に係る調整項目の額(貸倒引当金以外)(△)	87,570	76,810
7	オン・バランス資産の額(イ)	10,962,515	11,022,453
デリバティブ取引等に関する額(2)			
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	65,501	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	32,197	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)	97,698	83,851
レボ取引等に関する額(3)			
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	174,742	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)	174,742	181,424
オフ・バランス取引に関する額(4)			
19	オフ・バランス取引の想定元本の額	2,151,312	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(△)	1,961,790	1,961,358
22	オフ・バランス取引に関する額(ニ)	189,522	185,454
連結レバレッジ比率又は持株レバレッジ比率(5)			
23	資本の額(ホ)	974,036	1,010,952
24	総エクスポージャーの額((イ)+(ロ)+(ハ)+(ニ))(ヘ)	11,424,477	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))	8.52	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	3.15	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	—	—
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)			
	総エクスポージャーの額(ヘ)	11,424,477	11,473,184
	日本銀行に対する預け金の額	3,628,308	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')	15,052,785	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'))	6.47	6.71
平均値の開示(7)			
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)	11,424,477	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)	15,052,785	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)	8.52	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)	6.47	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。

2. 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6月期)	前四半期末 (2024年3月期)
1	貸借対照表における総資産の額	13,748,513	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(△)	3,553,059	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・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	1,988	10,161
8a	デリバティブ取引等に関する額	97,698	83,851
8b	デリバティブ取引等に関連する資産の額(△)	95,710	73,690
9	レボ取引等に関する調整額	174,742	181,424
9a	レボ取引等に関する額	174,742	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	189,176	184,451
11	Tier1資本に係る調整項目の額(貸倒引当金)(△)	4,891	5,272
12	その他の調整項目	△ 143,734	△ 127,190
12a	Tier1資本に係る調整項目の額(貸倒引当金以外)(△)	63,269	51,777
12b	支払承諾見返勘定の額(△)	52,818	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(△)	27,647	22,700
13	総エクスポージャーの額	10,412,734	10,413,843

(注) 「国際様式(LR1)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LR1に記載された番号です。

【第二面】

国際様式(LR2)の該当番号(注)	項目	当四半期末 (2024年6月期)	前四半期末 (2024年3月期)
オン・バランス資産の額(1)			
1	個別項目調整前のオン・バランス資産の額	10,046,924	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(△)	27,647	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)(△)	4,891	5,272
6	Tier1資本に係る調整項目の額(貸倒引当金以外)(△)	63,269	51,777
7	オン・バランス資産の額(イ)	9,951,117	9,964,115
デリバティブ取引等に関する額(2)			
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	65,501	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	32,197	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)	97,698	83,851
レボ取引等に関する額(3)			
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	174,742	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)	174,742	181,424
オフ・バランス取引に関する額(4)			
19	オフ・バランス取引の想定元本の額	2,128,201	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(△)	1,939,024	1,933,756
22	オフ・バランス取引に関する額(ニ)	189,176	184,451
連結レバレッジ比率又は持株レバレッジ比率(5)			
23	資本の額(ホ)	887,663	922,045
24	総エクスポージャーの額((イ)+(ロ)+(ハ)+(ニ))(ヘ)	10,412,734	10,413,843
25	単体レバレッジ比率((ホ)/(ヘ))	8.52	8.85
26	適用する所要単体レバレッジ比率	3.15	3.00
27	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(6)			
	総エクスポージャーの額(ヘ)	10,412,734	10,413,843
	日本銀行に対する預け金の額	3,553,059	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')	13,965,794	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'))	6.35	6.60
平均値の開示(7)			
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)	10,412,734	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)	13,965,794	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)	8.52	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)	6.35	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