

連結レバレッジ比率の構成に関する事項(平成27年9月期)

(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 | 当中間期末 | 前中間期末 |
|------------------------------|------------------------------|--|-----------|-------|
| 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 | 7,981,796 | - |
| 1a | 1 | 連結貸借対照表における総資産の額 | 8,055,687 | - |
| 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(△) | 73,890 | - |
| 2 | 7 | Tier1資本に係る調整項目の額(△) | 11,378 | - |
| 3 | | オン・バランス資産の額(イ) | 7,970,418 | - |
| 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再構築コストの額 | 11,754 | - |
| 5 | | デリバティブ取引等に関するアドオンの額 | 19,622 | - |
| | | 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 | 28,270 | - |
| 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) | 59,646 | - |
| 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 | 123,675 | - |
| 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) | 123,675 | - |
| 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 | 1,865,467 | - |
| 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(△) | 1,617,431 | - |
| 19 | 6 | オフ・バランス取引に関する額(ニ) | 248,035 | - |
| 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) | 547,307 | - |
| 21 | 8 | 総エクスポージャーの額((イ)+(ロ)+(ハ)+(ニ))(ヘ) | 8,401,776 | - |
| 22 | | 連結レバレッジ比率又は持株レバレッジ比率((ホ)/(ヘ)) | 6.51 | - |

(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平成26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。

連結レバレッジ比率の構成に関する事項(平成27年9月期)

(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 | 当中間期末 | 前四半期末 |
|------------------------------|------------------------------|--|-----------|-----------|
| 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 | 7,981,796 | 8,281,158 |
| 1a | 1 | 連結貸借対照表における総資産の額 | 8,055,687 | 8,361,705 |
| 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(△) | 73,890 | 80,546 |
| 2 | 7 | Tier1資本に係る調整項目の額(△) | 11,378 | 13,947 |
| 3 | | オン・バランス資産の額(イ) | 7,970,418 | 8,267,211 |
| 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再構築コストの額 | 11,754 | 10,535 |
| 5 | | デリバティブ取引等に関するアドオンの額 | 19,622 | 19,400 |
| | | 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 | 28,270 | 28,571 |
| 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) | 59,646 | 58,508 |
| 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 | 123,675 | 111,947 |
| 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) | 123,675 | 111,947 |
| 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 | 1,865,467 | 1,860,794 |
| 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(△) | 1,617,431 | 1,606,936 |
| 19 | 6 | オフ・バランス取引に関する額(ニ) | 248,035 | 253,858 |
| 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) | 547,307 | 555,601 |
| 21 | 8 | 総エクスポージャーの額((イ)+(ロ)+(ハ)+(ニ))(ヘ) | 8,401,776 | 8,691,525 |
| 22 | | 連結レバレッジ比率又は持株レバレッジ比率((ホ)/(ヘ)) | 6.51 | 6.39 |

(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平成26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。