

＜連結レバレッジ比率の構成に関する事項＞

【2020年6月末】

(単位：百万円、%)

国際様式 (表2)の該 当番号	国際様式 (表1)の 該当番号	項目	当四半期 期末 2020年6月	前四半期 期末 2020年3月
オン・バランス資産の額 (1)				
1		調整項目控除前のオン・バランス資産の額	3,822,270	5,077,121
1a	1	連結貸借対照表における総資産の額	3,839,391	5,097,268
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 (△)	17,120	20,146
2	7	Tier1 資本に係る調整項目の額 (△)	11,446	11,105
3		オン・バランス資産の額 (イ)	3,810,823	5,066,016
デリバティブ取引等に関する額 (2)				
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	122	472
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	1,053	805
		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	-	652
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)	1,175	1,930
レポ取引等に関する額 (3)				
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	1,795	6,047
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)	1,795	6,047
オフ・バランス取引に関する額 (4)				
17		オフ・バランス取引の想定元本の額	439,418	439,862
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 (△)	373,431	373,223
19	6	オフ・バランス取引に関する額 (ニ)	65,987	66,639
連結レバレッジ比率 (5)				
20		資本の額 (ホ)	243,478	221,604
21	8	総エクスポージャーの額 (イ) + (ロ) + (ハ) + (ニ) (ヘ)	3,879,783	5,140,634
22		連結レバレッジ比率 (ホ) / (ヘ)	6.27%	4.31%
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 (6)				
		総エクスポージャーの額 (ヘ)	3,879,783	-
		日本銀行に対する預け金の額	1,091,631	-
		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')	4,971,414	-
		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 (ホ) / (ヘ')	4.89%	-

- ・上記は、平成26年金融庁告示第7号の別紙様式第6号に基づく開示事項です。
- ・旧計算告示第7条の規定によってデリバティブ取引に関する額を算出しております。
- ・「国際様式の該当番号」とは、バーゼル銀行監督委員会より2014年1月に公表された「レバレッジ比率の枠組みと開示要件を定める国際合意文書」における開示様式に記載された項目番号です。

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 (該当差異がある場合に限る。) 平成31年金融庁告示第11号における令和2年6月29日付の改正に伴い、日本銀行に対する預け金の額を総エクスポージャーより除外したことが要因です。