

レバレッジ比率の構成に関する事項（2019年3月末・速報値）

【連結】

(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	2019年3月末	2018年12月末
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	14,858,214	14,657,963
1a	1	連結貸借対照表における総資産の額	14,964,129	14,808,584
1b	2	連結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(Δ)	-	-
1c	7	連結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(Δ)	105,914	150,620
2	7	Tier1資本に係る調整項目の額(Δ)	37,993	40,802
3		オン・バランス資産の額 (イ)	14,820,221	14,617,160
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再構築コストの額	-	35,823
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	20,784	-
5		デリバティブ取引等に関するアドオンの額	-	45,312
		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	-	11,228
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	18,221	-
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	-	-
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	-	-
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)	12,010	-
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)	26,994	92,364
レボ取引等に関する額 (3)				
12		レボ取引等に関する資産の額	14,999	45,226
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	2,549	3,708
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)	17,549	48,934
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	3,318,610	3,289,152
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)	2,827,074	2,798,490
19	6	オフ・バランス取引に関する額 (ニ)	491,535	490,662
連結レバレッジ比率 (5)				
20		資本の額 (ホ)	908,877	903,907
21	8	総エクスポージャーの額((イ)+(ロ)+(ハ)+(ニ)) (ヘ)	15,356,300	15,249,122
22		連結レバレッジ比率((ホ)/(ヘ))	5.91	5.92

- (注) 1. 「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. 上記計表は、当期末より新告示が適用されているため新告示の改正事項を反映し、作成しております。

【単体】

当期末より新告示が適用されているため、新告示に基づき「単体レバレッジ比率に関する開示事項」を記載しております。

(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	2019年3月末	2018年12月末
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	14,794,606	
1a	1	貸借対照表における総資産の額	14,891,602	
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)	96,996	
2	7	Tier1 資本に係る調整項目の額(Δ)	50,347	
3		オン・バランス資産の額 (イ)	14,744,259	
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	20,784	
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	18,221	
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	-	
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)	12,010	
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)	26,994	
レボ取引等に関する額 (3)				
12		レボ取引等に関する資産の額	14,999	
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	2,549	
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)	17,549	
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	3,307,125	
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)	2,824,764	
19	6	オフ・バランス取引に関する額 (ニ)	482,360	
単体レバレッジ比率 (5)				
20		資本の額 (ホ)	830,915	
21	8	総エクスポージャーの額((イ)+(ロ)+(ハ)+(ニ)) (ヘ)	15,271,163	
22		単体レバレッジ比率((ホ)/(ヘ))	5.44	

(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。