

レバレッジ比率の構成に関する事項（2019年6月末）

【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6月末	2019年3月末
<b>オン・バランス資産の額 (1)</b>				
1		調整項目控除前のオン・バランス資産の額	15,174,288	14,858,214
1a	1	連結貸借対照表における総資産の額	15,284,252	14,964,129
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)	109,963	105,914
2	7	Tier1資本に係る調整項目の額(Δ)	36,665	37,993
3		オン・バランス資産の額 (イ)	15,137,623	14,820,221
<b>デリバティブ取引等に関する額 (2)</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	19,857	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	17,964	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)	10,814	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)	27,007	26,994
<b>レボ取引等に関する額 (3)</b>				
12		レボ取引等に関する資産の額	14,999	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	1,885	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)	16,885	17,549
<b>オフ・バランス取引に関する額 (4)</b>				
17		オフ・バランス取引の想定元本の額	3,315,617	3,318,610
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)	2,825,364	2,827,074
19	6	オフ・バランス取引に関する額 (ニ)	490,253	491,535
<b>連結レバレッジ比率 (5)</b>				
20		資本の額 (ホ)	914,674	908,877
21	8	総エクスポージャーの額((イ)+(ロ)+(ハ)+(ニ)) (ヘ)	15,671,770	15,356,300
22		連結レバレッジ比率(ホ)÷(ヘ)	5.83	5.91

(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。

【単体】

(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6月末	2019年3月末
<b>オン・バランス資産の額 (1)</b>				
1		調整項目控除前のオン・バランス資産の額	15,117,105	14,794,606
1a	1	貸借対照表における総資産の額	15,218,382	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)	101,277	96,996
2	7	Tier1資本に係る調整項目の額(Δ)	49,397	50,347
3		オン・バランス資産の額 (イ)	15,067,708	14,744,259
<b>デリバティブ取引等に関する額 (2)</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	19,857	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	17,963	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)	10,814	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)	27,007	26,994
<b>レボ取引等に関する額 (3)</b>				
12		レボ取引等に関する資産の額	14,999	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	1,885	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)	16,885	17,549
<b>オフ・バランス取引に関する額 (4)</b>				
17		オフ・バランス取引の想定元本の額	3,303,653	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)	2,822,414	2,824,764
19	6	オフ・バランス取引に関する額 (ニ)	481,239	482,360
<b>単体レバレッジ比率 (5)</b>				
20		資本の額 (ホ)	839,740	830,915
21	8	総エクスポージャーの額((イ)+(ロ)+(ハ)+(ニ)) (ヘ)	15,592,840	15,271,163
22		単体レバレッジ比率(ホ)/(ヘ)	5.38	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。