

レバレッジ比率の構成に関する事項（2019年12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12月末	2019年9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	15,582,505	15,389,296
1a	1	連結貸借対照表における総資産の額	15,689,670	15,504,916
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(△)	-	-
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(△)	107,164	115,619
2	7	Tier1資本に係る調整項目の額(△)	35,852	35,485
3		オン・バランス資産の額 (イ)	15,546,653	15,353,811
<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	20,997	19,342
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	19,271	17,596
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入れた変動証拠金の対価の額のうち控除する額(△)	14,240	11,823
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(△)		
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)	26,027	25,115
<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	17,999	14,999
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	2,582	1,850
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)	20,581	16,849
<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	3,303,329	3,351,596
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(△)	2,807,460	2,851,321
19	6	オフ・バランス取引に関する額 (ニ)	495,868	500,275
<b>連結レバレッジ比率 (5)</b>				
20		資本の額 (ホ)	945,255	925,255
21	8	総エクスポージャーの額((イ)+(ロ)+(ハ)+(ニ)) (ヘ)	16,089,131	15,896,052
22		連結レバレッジ比率((ホ)/(ヘ))	5.87	5.82

(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12月末	2019年9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	15,513,421	15,323,048
1a	1	貸借対照表における総資産の額	15,612,285	15,430,212
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)	98,863	107,163
2	7	Tier1 資本に係る調整項目の額(Δ)	49,177	48,972
3		オン・バランス資産の額 (イ)	15,464,243	15,274,075
<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	20,994	19,342
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	19,230	17,596
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)	14,240	11,823
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)	25,984	25,115
<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	17,999	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	2,582	1,850
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)	20,581	16,849
<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	3,292,750	3,342,095
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)	2,806,899	2,850,379
19	6	オフ・バランス取引に関する額 (ニ)	485,851	491,715
<b>単体レバレッジ比率 (5)</b>				
20		資本の額 (ホ)	864,900	847,786
21	8	総エクスポージャーの額((イ)+(ロ)+(ハ)+(ニ)) (ヘ)	15,996,661	15,807,756
22		単体レバレッジ比率((ホ)/(ヘ))	5.40	5.36

(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。