

レバレッジ比率の構成に関する事項（2020年3月末・確定値）

【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	2020年3月末	2019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	15,501,329	15,582,505
1a	1	連結貸借対照表における総資産の額	15,609,936	15,689,670
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)	108,606	107,164
2	7	Tier1資本に係る調整項目の額(Δ)	34,527	35,852
3		オン・バランス資産の額 (イ)	15,466,802	15,546,653
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	19,065	20,997
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	17,851	19,271
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)	17,515	14,240
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)	19,402	26,027
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	19,999	17,999
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	9,504	2,582
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)	29,504	20,581
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	3,371,918	3,303,329
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)	2,871,385	2,807,460
19	6	オフ・バランス取引に関する額 (ニ)	500,532	495,868
連結レバレッジ比率 (5)				
20		資本の額 (ホ)	887,665	945,255
21	8	総エクスポージャーの額((イ)+(ロ)+(ハ)+(ニ)) (ヘ)	16,016,242	16,089,131
22		連結レバレッジ比率((ホ)/(ヘ))	5.54	5.87

(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	2020年3月末	2019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	15,436,508	15,513,421
1a	1	貸借対照表における総資産の額	15,537,059	15,612,285
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(△)	100,551	98,863
2	7	Tier1 資本に係る調整項目の額(△)	50,465	49,177
3		オン・バランス資産の額 (イ)	15,386,042	15,464,243
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	19,065	20,994
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	17,850	19,230
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(△)	17,515	14,240
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)	19,401	25,984
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	19,999	17,999
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	9,504	2,582
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)	29,504	20,581
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	3,360,776	3,292,750
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(△)	2,868,607	2,806,899
19	6	オフ・バランス取引に関する額 (ニ)	492,169	485,851
単体レバレッジ比率 (5)				
20		資本の額 (ホ)	807,435	864,900
21	8	総エクスポージャーの額((イ)+(ロ)+(ハ)+(ニ)) (ヘ)	15,927,116	15,996,661
22		単体レバレッジ比率((ホ)/(ヘ))	5.06	5.40

(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。