

レバレッジ比率の構成に関する事項（2020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 | 2020年6月末 | 2020年3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 | 13,727,100 | 15,501,329 |
| 1a | 1 | 連結貸借対照表における総資産の額 | 13,828,107 | 15,609,936 |
| 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) | 101,007 | 108,606 |
| 2 | 7 | Tier1資本に係る調整項目の額(Δ) | 32,696 | 34,527 |
| 3 | | オン・バランス資産の額 (イ) | 13,694,403 | 15,466,802 |
| 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 | 18,155 | 19,065 |
| 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 | 17,589 | 17,851 |
| 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) | 17,012 | 17,515 |
| 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) | 18,732 | 19,402 |
| 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 | 24,999 | 19,999 |
| 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 | 6,403 | 9,504 |
| 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) | 31,403 | 29,504 |
| 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 | 3,416,844 | 3,371,918 |
| 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) | 2,906,450 | 2,871,385 |
| 19 | 6 | オフ・バランス取引に関する額 (ニ) | 510,394 | 500,532 |
| 連結レバレッジ比率 (5) | | | | |
| 20 | | 資本の額 (ホ) | 931,540 | 887,665 |
| 21 | 8 | 総エクスポージャーの額((イ)+(ロ)+(ハ)+(ニ)) (ヘ) | 14,254,933 | 16,016,242 |
| 22 | | 連結レバレッジ比率((ホ)/(ヘ)) | 6.53 | 5.54 |
| 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) | 14,254,933 | |
| | | 日本銀行に対する預け金の額 | 2,925,414 | |
| | | 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') | 17,180,347 | |
| | | 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')) | 5.42 | |

(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。

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

連結レバレッジ比率は、前四半期比0.99%増加しました。

2019年(平成31年)金融庁告示第11号(以下、告示)において、2020年(令和2年)6月30日付告示改正に伴い、日本銀行に対する預け金の額が総エクスポージャーの額より除外されたこと、および株式相場回復により「その他有価証券評価差額金」が増加したことが主な要因です。

【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6月末 | 2020年3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 | 13,667,263 | 15,436,508 |
| 1a | 1 | 貸借対照表における総資産の額 | 13,760,484 | 15,537,059 |
| 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) | 93,221 | 100,551 |
| 2 | 7 | Tier1 資本に係る調整項目の額(Δ) | 48,622 | 50,465 |
| 3 | | オン・バランス資産の額 (イ) | 13,618,640 | 15,386,042 |
| 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 | 18,154 | 19,065 |
| 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 | 17,589 | 17,850 |
| 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) | 17,012 | 17,515 |
| 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) | 18,731 | 19,401 |
| 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 | 24,999 | 19,999 |
| 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 | 6,403 | 9,504 |
| 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) | 31,403 | 29,504 |
| 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 | 3,404,275 | 3,360,776 |
| 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) | 2,902,145 | 2,868,607 |
| 19 | 6 | オフ・バランス取引に関する額 (ニ) | 502,129 | 492,169 |
| 単体レバレッジ比率 (5) | | | | |
| 20 | | 資本の額 (ホ) | 850,789 | 807,435 |
| 21 | 8 | 総エクスポージャーの額((イ)+(ロ)+(ハ)+(ニ)) (ヘ) | 14,170,905 | 15,927,116 |
| 22 | | 単体レバレッジ比率((ホ)/(ヘ)) | 6.00 | 5.06 |
| 日本銀行に対する預け金を算入する場合の単体レバレッジ比率 (6) | | | | |
| | | 総エクスポージャーの額 (ヘ) | 14,170,905 | |
| | | 日本銀行に対する預け金の額 | 2,921,807 | |
| | | 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') | 17,092,713 | |
| | | 日本銀行に対する預け金を算入する場合の単体レバレッジ比率((ホ)/(ヘ')) | 4.97 | |

(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。

前四半期の単体レバレッジ比率との間に著しい差異を生じた原因

単体レバレッジ比率は、前四半期比 0.93%増加しました。

2019 年(平成 31 年)金融庁告示第 11 号(以下、告示)において、2020 年(令和 2 年)6 月 30 日付告示改正に伴い、日本銀行に対する預け金の額が総エクスポージャーの額より除外されたこと、および株式相場回復により「その他有価証券評価差額金」が増加したことが主な要因です。