

## レバレッジ比率の構成に関する事項（2020年9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	2020年9月末	2020年6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	13,806,321	13,727,100
1a	1	連結貸借対照表における総資産の額	13,920,172	13,828,107
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(△)	113,850	101,007
2	7	Tier1資本に係る調整項目の額(△)	32,042	32,696
3		オン・バランス資産の額 (イ)	13,774,279	13,694,403
<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	27,832	18,155
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	20,581	17,589
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(△)	17,562	17,012
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)	30,852	18,732
<b>レポ取引等に関する額 (3)</b>				
12		レポ取引等に関する資産の額	24,999	24,999
13		レポ取引等に関する資産の額から控除した額(△)	-	-
14		レポ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	1,962	6,403
15		代理取引のエクスポージャーの額	-	-
16	5	レポ取引等に関する額 (ハ)	26,962	31,403
<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	3,481,323	3,416,844
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(△)	2,956,885	2,906,450
19	6	オフ・バランス取引に関する額 (ニ)	524,437	510,394
<b>連結レバレッジ比率 (5)</b>				
20		資本の額 (ホ)	946,002	931,540
21	8	総エクスポージャーの額((イ)+(ロ)+(ハ)+(ニ)) (ヘ)	14,356,532	14,254,933
22		連結レバレッジ比率((ホ)/(ヘ))	6.58	6.53
<b>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)</b>				
		総エクスポージャーの額 (ヘ)	14,356,532	14,254,933
		日本銀行に対する預け金の額	2,970,257	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')	17,326,790	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'))	5.45	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。

【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9月末	2020年6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	13,733,131	13,667,263
1a	1	貸借対照表における総資産の額	13,839,357	13,760,484
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(△)	106,226	93,221
2	7	Tier1資本に係る調整項目の額(△)	47,844	48,622
3		オン・バランス資産の額 (イ)	13,685,287	13,618,640
<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	27,832	18,154
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	20,581	17,589
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(△)	17,562	17,012
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)	30,852	18,731
<b>レポ取引等に関する額 (3)</b>				
12		レポ取引等に関する資産の額	24,999	24,999
13		レポ取引等に関する資産の額から控除した額(△)	-	-
14		レポ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	1,962	6,403
15		代理取引のエクスポージャーの額	-	-
16	5	レポ取引等に関する額 (ハ)	26,962	31,403
<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	3,480,310	3,404,275
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(△)	2,962,835	2,902,145
19	6	オフ・バランス取引に関する額 (ニ)	517,474	502,129
<b>単体レバレッジ比率 (5)</b>				
20		資本の額 (ホ)	862,526	850,789
21	8	総エクスポージャーの額((イ)+(ロ)+(ハ)+(ニ)) (ヘ)	14,260,577	14,170,905
22		単体レバレッジ比率((ホ)/(ヘ))	6.04	6.00
<b>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)</b>				
		総エクスポージャーの額 (ヘ)	14,260,577	14,170,905
		日本銀行に対する預け金の額	2,966,102	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')	17,226,680	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'))	5.00	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。