

レバレッジ比率の構成に関する事項（2020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	2020年12月末	2020年9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	14,099,481	13,806,321
1a	1	連結貸借対照表における総資産の額	14,253,060	13,920,172
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)	153,579	113,850
2	7	Tier1 資本に係る調整項目の額(Δ)	33,379	32,042
3		オン・バランス資産の額 (イ)	14,066,102	13,774,279
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	46,976	27,832
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	24,850	20,581
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)	16,232	17,562
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)	55,593	30,852
レポ取引等に関する額 (3)				
12		レポ取引等に関する資産の額	36,097	24,999
13		レポ取引等に関する資産の額から控除した額(Δ)	-	-
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	2,802	1,962
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)	38,900	26,962
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	3,422,219	3,481,323
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)	2,906,794	2,956,885
19	6	オフ・バランス取引に関する額 (ニ)	515,425	524,437
連結レバレッジ比率 (5)				
20		資本の額 (ホ)	977,858	946,002
21	8	総エクスポージャーの額((イ)+(ロ)+(ハ)+(ニ)) (ヘ)	14,676,022	14,356,532
22		連結レバレッジ比率((ホ)/(ヘ))	6.66	6.58
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)	14,676,022	14,356,532
		日本銀行に対する預け金の額	3,368,937	2,970,257
		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')	18,044,959	17,326,790
		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'))	5.41	5.45

(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12月末	2020年9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	14,017,478	13,733,131
1a	1	貸借対照表における総資産の額	14,163,663	13,839,357
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(△)	146,184	106,226
2	7	Tier1資本に係る調整項目の額(△)	48,433	47,844
3		オン・バランス資産の額 (イ)	13,969,045	13,685,287
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	46,976	27,832
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	24,849	20,581
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うち控除する額(△)	16,232	17,562
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)	55,593	30,852
レポ取引等に関する額 (3)				
12		レポ取引等に関する資産の額	36,097	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	2,802	1,962
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)	38,900	26,962
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	3,424,014	3,480,310
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(△)	2,915,065	2,962,835
19	6	オフ・バランス取引に関する額 (ニ)	508,949	517,474
単体レバレッジ比率 (5)				
20		資本の額 (ホ)	892,573	862,526
21	8	総エクスポージャーの額((イ)+(ロ)+(ハ)+(ニ)) (ヘ)	14,572,489	14,260,577
22		単体レバレッジ比率((ホ)/(ヘ))	6.12	6.04
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)	14,572,489	14,260,577
		日本銀行に対する預け金の額	3,365,526	2,966,102
		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')	17,938,015	17,226,680
		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	5.00

(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。