

## レバレッジ比率の構成に関する事項（2021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	2021年12月末	2021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	14,794,287	14,601,892
1a	1	連結貸借対照表における総資産の額	14,915,261	14,712,191
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)	120,973	110,298
2	7	Tier1資本に係る調整項目の額(Δ)	38,933	39,402
3		オン・バランス資産の額 (イ)	14,755,354	14,562,489
<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	36,635	37,855
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	31,579	27,487
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)	13,620	15,881
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)	54,594	49,461
<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	29,999	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	5,764	3,971
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)	35,763	28,971
<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	3,534,688	3,490,192
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)	3,005,873	2,962,621
19	6	オフ・バランス取引に関する額 (ニ)	528,815	527,570
<b>連結レバレッジ比率 (5)</b>				
20		資本の額 (ホ)	1,032,670	1,032,175
21	8	総エクスポージャーの額((イ)+(ロ)+(ハ)+(ニ)) (ヘ)	15,374,528	15,168,493
22		連結レバレッジ比率((ホ)/(ヘ))	6.71	6.80
<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)	15,374,528	15,168,493
		日本銀行に対する預け金の額	3,599,097	3,759,471
		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')	18,973,626	18,927,964
		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'))	5.44	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	2021年12月末	2021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	14,698,617	14,509,153
1a	1	貸借対照表における総資産の額	14,817,450	14,617,304
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)	118,832	108,150
2	7	Tier1資本に係る調整項目の額(Δ)	47,117	47,420
3		オン・バランス資産の額 (イ)	14,651,499	14,461,732
<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	36,635	37,855
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	31,579	27,486
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)	13,620	15,881
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)	54,594	49,460
<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	29,999	24,999
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	5,764	3,971
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)	35,763	28,971
<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	3,538,443	3,494,303
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)	3,011,178	2,968,254
19	6	オフ・バランス取引に関する額 (ニ)	527,264	526,048
<b>単体レバレッジ比率 (5)</b>				
20		資本の額 (ホ)	945,296	945,138
21	8	総エクスポージャーの額((イ)+(ロ)+(ハ)+(ニ)) (ヘ)	15,269,122	15,066,213
22		単体レバレッジ比率((ホ)/(ヘ))	6.19	6.27
<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)	15,269,122	15,066,213
		日本銀行に対する預け金の額	3,596,741	3,756,946
		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')	18,865,863	18,823,160
		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'))	5.01	5.02

(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。