

レバレッジ比率の構成に関する事項（2023年9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	2023年9月末	2023年6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	16,243,882	15,888,578
1a	1	連結貸借対照表における総資産の額	16,464,870	16,071,296
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(△)	220,987	182,717
2	7	Tier1 資本に係る調整項目の額(△)	49,290	46,060
3		オン・バランス資産の額 (イ)	16,194,591	15,842,517
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	95,377	70,514
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	54,025	53,495
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(△)	57,349	62,748
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)	92,053	61,261
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	48,650	38,291
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	8,033	7,929
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)	56,684	46,221
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	3,425,211	3,452,622
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(△)	2,884,129	2,907,822
19	6	オフ・バランス取引に関する額 (ニ)	541,082	544,799
連結レバレッジ比率 (5)				
20		資本の額 (ホ)	1,049,156	1,055,153
21	8	総エクスポージャーの額((イ)+(ロ)+(ハ)+(ニ)) (ヘ)	16,884,412	16,494,800
22		連結レバレッジ比率((ホ)÷(ヘ))	6.21	6.39
		適用する所要連結レバレッジ比率	3.00	3.00
		適用する所要連結レバレッジ・バッファ率	-	-
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)	16,884,412	16,494,800
		日本銀行に対する預け金の額	3,908,828	3,997,354
		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')	20,793,241	20,492,155
		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'))	5.04	5.14

(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	2023年9月末	2023年6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	16,137,229	15,787,220
1a	1	貸借対照表における総資産の額	16,356,105	15,967,869
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(△)	218,875	180,649
2	7	Tier1資本に係る調整項目の額(△)	59,161	56,313
3		オン・バランス資産の額 (イ)	16,078,068	15,730,906
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	95,377	70,514
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	54,025	53,495
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(△)	57,349	62,748
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)	92,053	61,261
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	48,650	38,291
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	8,033	7,929
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)	56,684	46,221
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	3,448,103	3,475,880
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(△)	2,906,632	2,930,617
19	6	オフ・バランス取引に関する額 (ニ)	541,470	545,263
単体レバレッジ比率 (5)				
20		資本の額 (ホ)	958,974	966,778
21	8	総エクスポージャーの額((イ)+(ロ)+(ハ)+(ニ)) (ヘ)	16,768,276	16,383,652
22		単体レバレッジ比率((ホ)/(ヘ))	5.71	5.90
		適用する所要単体レバレッジ比率	3.00	3.00
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)	16,768,276	16,383,652
		日本銀行に対する預け金の額	3,905,650	3,994,196
		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')	20,673,927	20,377,849
		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'))	4.63	4.74

(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。