

IV. レバレッジ比率に関する開示事項

1. 連結レバレッジ比率の構成に関する事項

(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年度末	2019年度末
オン・バランス資産の額				
1		調整項目控除前のオン・バランス資産の額	8,328,347	8,397,471
1a	1	連結貸借対照表における総資産の額	8,350,151	8,416,864
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 (△)	21,803	19,392
2	7	Tier1資本に係る調整項目の額 (△)	31,568	30,873
3		オン・バランス資産の額 (イ)	8,296,778	8,366,597
デリバティブ取引等に関する額				
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		
		デリバティブ取引等に関する再構築コストの額	7,521	7,838
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		
		デリバティブ取引等に関するアドオンの額	20,547	18,365
		デリバティブ取引等に関連して現金で差し入れた証拠金の対価の額	4,298	1,388
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		
		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現金で差し入れた証拠金の対価の額	—	—
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 (△)	—	—
8		清算会員である銀行又は銀行持株会社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)	32,367	27,591
レボ取引等に関する額				
12		レボ取引等に関する資産の額	—	—
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	6,577	3,239
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)	6,577	3,239
オフ・バランス取引に関する額				
17		オフ・バランス取引の想定元本の額	483,646	513,431
18		オフ・バランス取引に係るエクスポージャーの額への交換調整の額 (△)	389,827	423,467
19	6	オフ・バランス取引に関する額 (ニ)	93,819	89,963
連結レバレッジ比率				
20		資本の額 (ホ)	513,813	454,548
21	8	総エクスポージャーの額 ((イ) + (ロ) + (ハ) + (ニ)) (ヘ)	8,429,543	8,487,393
22		連結レバレッジ比率 ((ホ) / (ヘ))	6.09%	5.35%
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				
		総エクスポージャーの額 (ヘ)	8,429,543	
		日本銀行に対する預け金の額	2,265,605	
		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')	10,695,148	
		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'))	4.80%	

2. 前連結会計年度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

2020年度末の連結レバレッジ比率は、前連結会計年度に対し0.74%上昇し6.09%となりました。

前連結会計年度に対し、資本の額に含まれる有価証券評価差額金が増加したことが主な要因となっております。

3. 単体レバレッジ比率の構成に関する事項

(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年度末	2019年度末
オン・バランス資産の額				
1		調整項目控除前のオン・バランス資産の額	8,311,333	8,383,792
1a	1	貸借対照表における総資産の額	8,333,136	8,403,185
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 (△)	21,803	19,392
2	7	Tier1資本に係る調整項目の額 (△)	30,809	35,055
3		オン・バランス資産の額 (イ)	8,280,524	8,348,736
デリバティブ取引等に関する額				
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		
		デリバティブ取引等に関する再構築コストの額	7,521	7,838
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		
		デリバティブ取引等に関するアドオンの額	20,547	18,365
		デリバティブ取引等に関連して現金で差し入れた証拠金の対価の額	4,298	1,388
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		
		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現金で差し入れた証拠金の対価の額	—	—
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 (△)	—	—
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)	32,367	27,591
レポ取引等に関する額				
12		レポ取引等に関する資産の額	—	—
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	6,577	3,239
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)	6,577	3,239
オフ・バランス取引に関する額				
17		オフ・バランス取引の想定元本の額	483,566	511,451
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 (△)	389,781	421,731
19	6	オフ・バランス取引に関する額 (ニ)	93,784	89,720
単体レバレッジ比率				
20		資本の額 (ホ)	483,546	433,407
21	8	総エクスポージャーの額 ((イ) + (ロ) + (ハ) + (ニ)) (ヘ)	8,413,254	8,469,288
22		単体レバレッジ比率 ((ホ) / (ヘ))	5.74%	5.11%
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				
		総エクスポージャーの額 (ヘ)	8,413,254	
		日本銀行に対する預け金の額	2,265,605	
		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')	10,678,859	
		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'))	4.52%	

4. 前事業年度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

2020年度末の単体レバレッジ比率は、前事業年度に対し0.63%上昇し5.74%となりました。

前事業年度に対し、資本の額に含まれる有価証券評価差額金が増加したことが主な要因となっております。