

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	2019年度末	2018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	8,397,471	8,121,375
1a	1	連結貸借対照表における総資産の額	8,416,864	8,140,134
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 (△)	19,392	18,759
2	7	Tier1資本に係る調整項目の額 (△)	30,873	27,942
3		オン・バランス資産の額 (イ)	8,366,597	8,093,433
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	7,838	7,125
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	18,365	16,767
		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	1,388	914
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)	27,591	24,807
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	3,239	2,238
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)	3,239	2,238
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	513,431	512,405
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 (△)	423,467	420,666
19	6	オフ・バランス取引に関する額 (ニ)	89,963	91,738
連結レバレッジ比率				
20		資本の額 (ホ)	454,548	498,438
21	8	総エクスポージャーの額 ((イ) + (ロ) + (ハ) + (ニ)) (ヘ)	8,487,393	8,212,218
22		連結レバレッジ比率 ((ホ) / (ヘ))	5.35%	6.06%

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

2019年度末の連結レバレッジ比率は、前連結会計年度に対し△0.71%低下し5.35%となりました。

新型コロナウイルスの影響により、資本の額に含まれる有価証券評価差額金が減少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	2019年度末	2018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	8,383,792	8,103,805
1a	1	貸借対照表における総資産の額	8,403,185	8,122,564
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 (△)	19,392	18,759
2	7	Tier1資本に係る調整項目の額 (△)	35,055	30,840
3		オン・バランス資産の額 (イ)	8,348,736	8,072,965
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	7,838	7,125
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	18,365	16,767
		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	1,388	914
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)	27,591	24,807
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	3,239	2,238
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)	3,239	2,238
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	511,451	509,159
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 (△)	421,731	417,798
19	6	オフ・バランス取引に関する額 (ニ)	89,720	91,361
単体レバレッジ比率				
20		資本の額 (ホ)	433,407	474,771
21	8	総エクスポージャーの額 ((イ) + (ロ) + (ハ) + (ニ)) (ヘ)	8,469,288	8,191,372
22		単体レバレッジ比率 ((ホ) / (ヘ))	5.11%	5.79%

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

2019年度末の単体レバレッジ比率は、前事業年度に対し△0.68%低下し5.11%となりました。

新型コロナウイルスの影響により、資本の額に含まれる有価証券評価差額金が減少したことが主な要因となっております。