

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

2022年度末

(単位：百万円)

項番 (国際様式 (LR1) の該当番号)	項目	2022年度末	2021年度末
1	連結貸借対照表における総資産の額	10,662,300	
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 (△)	—	
3	リスク移転の認識に係る要件を充足しない証券化エクスポージャーに係る調整	—	
4	中央銀行預け金に係る除外による調整 (△)	1,765,181	
5	顧客資産のうち、連結貸借対照表に計上されている金額 (△)	—	
6	有価証券の売買を約定日基準により会計処理している場合における調整項目	—	
7	キャッシュ・プーリング契約に基づく資金の移動に係る調整項目	—	
8	デリバティブ取引等に関する調整額	16,043	
8a	デリバティブ取引等に関する額	23,678	
8b	デリバティブ取引等に関連する資産の額 (△)	7,635	
9	レポ取引等に関する調整額	12,544	
9a	レポ取引等に関する額	12,544	
9b	レポ取引等に関する額 (△)	—	
10	オフ・バランス取引に関する額	90,928	
11	Tier 1 資本に係る調整項目の額 (貸倒引当金) (△)	15,324	
12	その他の調整項目	△ 29,128	
12a	Tier 1 資本に係る調整項目の額 (貸倒引当金以外) (△)	17,386	
12b	支払承諾見返勘定の額 (△)	8,527	
12c	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 (相殺した額に相当する部分に限る。)	—	
12d	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 (△)	3,213	
12e	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。)	—	
13	総エクスポージャーの額	8,972,181	

(単位：百万円)

項番 (国際様式 (LR2) の該当番号)	項目	2022年度末	2021年度末
オン・バランス資産の額 (1)			
1	個別項目調整前のオン・バランス資産の額	8,880,955	
2	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 (相殺した額に相当する部分に限る。)	—	
3	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 (△)	3,213	
4	レポ取引等により受領した証券の計上額 (△)	—	
5	Tier 1 資本に係る調整項目の額 (貸倒引当金) (△)	15,324	
6	Tier 1 資本に係る調整項目の額 (貸倒引当金以外) (△)	17,386	
7	オン・バランス資産の額 (イ)	8,845,030	
デリバティブ取引等に関する額 (2)			
8	デリバティブ取引等に関するRCの額に1.4を乗じた額	6,924	
9	デリバティブ取引等に関するPFEの額に1.4を乗じた額	16,753	
10	間接清算参加者に適格中央清算機関の債務履行を保証していない場合に零とした中央清算機関向けエクスポージャーの額 (△)	—	
11	クレジット・デリバティブ等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	—	
12	クレジット・デリバティブ等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 (△)	—	
13	デリバティブ取引等に関する額 (ロ)	23,678	
レポ取引等に関する額 (3)			
14	レポ取引等に関する資産の額	—	
15	レポ取引等に関する資産の額から控除した額 (△)	—	
16	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	12,544	
17	代理取引のエクスポージャーの額	—	
18	レポ取引等に関する額 (ハ)	12,544	
オフ・バランス取引に関する額 (4)			
19	オフ・バランス取引の想定元本の額	450,676	
20	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 (△)	359,748	
22	オフ・バランス取引に関する額 (ニ)	90,928	
連結レバレッジ比率 (5)			
23	資本の額 (ホ)	478,782	
24	総エクスポージャーの額 ((イ) + (ロ) + (ハ) + (ニ)) (ヘ)	8,972,181	
25	連結レバレッジ比率 ((ホ) / (ヘ))	5.33%	
26	適用する所要連結レバレッジ比率	3.00%	
27	適用する所要連結レバレッジ・バッファ比率		
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)	8,972,181	
	日本銀行に対する預け金の額	1,765,181	
	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')	10,737,363	
	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'))	4.45%	
平均値の開示 (7)			
28	レポ取引等に関する資産の額 (控除後) に係る平均値 ((ト) + (チ))	—	
	レポ取引等に関する資産の額に係る平均値 (ト)	—	
	レポ取引等に関する資産の額から控除した額に係る平均値 (△) (チ)	—	
29	レポ取引等に関する資産の額 (控除後) に係る四半期末の値 ((リ) + (ヌ))	—	
14	レポ取引等に関する資産の額に係る四半期末の値 (リ)	—	
15	レポ取引等に関する資産の額から控除した額に係る四半期末の値 (△) (ヌ)	—	
30	総エクスポージャーの額 (レポ取引等に関する資産の額 (控除後) に係る平均値を使用し、(ル) 日本銀行に対する預け金を算入しない場合)	8,972,181	
30a	総エクスポージャーの額 (レポ取引等に関する資産の額 (控除後) に係る平均値を使用し、(ヲ) 日本銀行に対する預け金を算入する場合)	10,737,363	
31	連結レバレッジ比率 (レポ取引等に関する資産の額 (控除後) に係る平均値を使用し、日本銀行に対する預け金を算入しない場合) ((ホ) / (ル))	5.33%	
31a	連結レバレッジ比率 (レポ取引等に関する資産の額 (控除後) に係る平均値を使用し、日本銀行に対する預け金を算入する場合) ((ホ) / (ヲ))	4.45%	

2021年度末

(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	2022年度末	2021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		8,533,073
1a	1	連結貸借対照表における総資産の額		8,559,595
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 (△)		26,521
2	7	Tier1資本に係る調整項目の額 (△)		36,411
3		オン・バランス資産の額 (イ)		8,496,662
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		6,893
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		23,567
		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		11,560
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)		42,021
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		5,829
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)		5,829
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		449,606
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 (△)		359,830
19	6	オフ・バランス取引に関する額 (ニ)		89,776
連結レバレッジ比率				
20		資本の額 (ホ)		490,108
21	8	総エクスポージャーの額 ((イ) + (ロ) + (ハ) + (ニ)) (ヘ)		8,634,289
22		連結レバレッジ比率 ((ホ) / (ヘ))		5.67%
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)		8,634,289
		日本銀行に対する預け金の額		2,588,944
		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')		11,223,233
		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'))		4.36%

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

該当ありません。

3. 単体レバレッジ比率の構成に関する事項

2022年度末

(単位：百万円)

項番 (国際様式 (LR1) の該当番号)	項 目	2022年度末	2021年度末
1	貸借対照表における総資産の額	10,633,101	
3	リスク移転の認識に係る要件を充足しない証券化エクスポージャーに係る調整	—	
4	中央銀行預け金に係る除外による調整 (△)	1,765,181	
5	顧客資産のうち、貸借対照表に計上されている金額 (△)		
6	有価証券の売買を約定日基準により会計処理している場合における調整項目	—	
7	キャッシュ・プーリング契約に基づく資金の移動に係る調整項目	—	
8	デリバティブ取引等に関する調整額	16,043	
8 a	デリバティブ取引等に関する額	23,679	
8 b	デリバティブ取引等に関連する資産の額 (△)	7,635	
9	レポ取引等に関する調整額	12,544	
9 a	レポ取引等に関する額	12,544	
9 b	レポ取引等に関する額 (△)	—	
10	オフ・バランス取引に関する額	90,920	
11	Tier 1 資本に係る調整項目の額 (貸倒引当金) (△)	16,771	
12	その他の調整項目	△ 22,032	
12 a	Tier 1 資本に係る調整項目の額 (貸倒引当金以外) (△)	10,291	
12 b	支払承諾見返勘定の額 (△)	8,527	
12 c	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 (相殺した額に相当する部分に限る。)	—	
12 d	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 (△)	3,213	
13	総エクスポージャーの額	8,948,625	

(単位：百万円)

項番 (国際様式 (LR2) の該当番号)	項目	2022年度末	2021年度末
オン・バランス資産の額 (1)			
1	個別項目調整前のオン・バランス資産の額	8,851,757	
2	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 (相殺した額に相当する部分に限る。)	—	
3	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 (△)	3,213	
4	レポ取引等により受領した証券の計上額 (△)	—	
5	Tier 1 資本に係る調整項目の額 (貸倒引当金) (△)	16,771	
6	Tier 1 資本に係る調整項目の額 (貸倒引当金以外) (△)	10,291	
7	オン・バランス資産の額 (イ)	8,821,481	
デリバティブ取引等に関する額 (2)			
8	デリバティブ取引等に関するRCの額に1.4を乗じた額	6,924	
9	デリバティブ取引等に関するPFEの額に1.4を乗じた額	16,754	
10	間接清算参加者に適格中央清算機関の債務履行を保証していない場合に零とした中央清算機関向けエクスポージャーの額 (△)	—	
11	クレジット・デリバティブ等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	—	
12	クレジット・デリバティブ等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 (△)	—	
13	デリバティブ取引等に関する額 (ロ)	23,679	
レポ取引等に関する額 (3)			
14	レポ取引等に関する資産の額	—	
15	レポ取引等に関する資産の額から控除した額 (△)	—	
16	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	12,544	
17	代理取引のエクスポージャーの額	—	
18	レポ取引等に関する額 (ハ)	12,544	
オフ・バランス取引に関する額 (4)			
19	オフ・バランス取引の想定元本の額	450,657	
20	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 (△)	359,737	
22	オフ・バランス取引に関する額 (ニ)	90,920	
単体レバレッジ比率 (5)			
23	資本の額 (ホ)	442,007	
24	総エクスポージャーの額 ((イ) + (ロ) + (ハ) + (ニ)) (ヘ)	8,948,625	
25	単体レバレッジ比率 ((ホ) / (ヘ))	4.93%	
26	適用する所要単体レバレッジ比率	3.00%	
27	適用する所要単体レバレッジ・バッファー比率		
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)	8,948,625	
	日本銀行に対する預け金の額	1,765,181	
	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')	10,713,807	
	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'))	4.12%	
平均値の開示 (7)			
28	レポ取引等に関する資産の額 (控除後) に係る平均値 ((ト) + (チ))	—	
	レポ取引等に関する資産の額に係る平均値 (ト)	—	
	レポ取引等に関する資産の額から控除した額に係る平均値 (△) (チ)	—	
29	レポ取引等に関する資産の額 (控除後) に係る四半期末の値 ((リ) + (ヌ))	—	
14	レポ取引等に関する資産の額に係る四半期末の値 (リ)	—	
15	レポ取引等に関する資産の額から控除した額に係る四半期末の値 (△) (ヌ)	—	
30	総エクスポージャーの額 (レポ取引等に関する資産の額 (控除後) に係る平均値を使用し、日本銀行に対する預け金を算入しない場合) (ル)	8,948,625	
30a	総エクスポージャーの額 (レポ取引等に関する資産の額 (控除後) に係る平均値を使用し、日本銀行に対する預け金を算入する場合) (ヲ)	10,713,807	
31	単体レバレッジ比率 (レポ取引等に関する資産の額 (控除後) に係る平均値を使用し、日本銀行に対する預け金を算入しない場合) ((ホ) / (ル))	4.93%	
31a	単体レバレッジ比率 (レポ取引等に関する資産の額 (控除後) に係る平均値を使用し、日本銀行に対する預け金を算入する場合) ((ホ) / (ヲ))	4.12%	

2021年度末

(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	2022年度末	2021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		8,511,460
1a	1	貸借対照表における総資産の額		8,537,982
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 (△)		26,521
2	7	Tier1資本に係る調整項目の額 (△)		33,760
3		オン・バランス資産の額 (イ)		8,477,700
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		6,893
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		23,567
		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		11,560
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)		42,021
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		5,829
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)		5,829
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		449,538
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 (△)		359,796
19	6	オフ・バランス取引に関する額 (ニ)		89,742
単体レバレッジ比率				
20		資本の額 (ホ)		456,374
21	8	総エクスポージャーの額 ((イ) + (ロ) + (ハ) + (ニ)) (ヘ)		8,615,293
22		単体レバレッジ比率 ((ホ) / (ヘ))		5.29%
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)		8,615,293
		日本銀行に対する預け金の額		2,588,944
		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´)		11,204,237
		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´))		4.07%

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

該当ありません。