

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

2023年度中間期末

(単位：百万円)

項番 (国際様式 (LR1) の該当番号)	項目	2023年度 中間期末	2022年度 中間期末
1	連結貸借対照表における総資産の額	10,552,363	
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 (△)	1,710,200	
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	21,857	
8 a	デリバティブ取引等に関する額	29,971	
8 b	デリバティブ取引等に関連する資産の額 (△)	8,114	
9	レポ取引等に関する調整額	6,466	
9 a	レポ取引等に関する額	6,466	
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	90,428	
11	Tier 1 資本に係る調整項目の額 (貸倒引当金) (△)	15,448	
12	その他の調整項目	△ 55,815	
12 a	Tier 1 資本に係る調整項目の額 (貸倒引当金以外) (△)	18,003	
12 b	支払承諾見返勘定の額 (△)	8,255	
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 (△)	29,557	
12 e	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	8,889,650	

項番 (国際様式 (LR2) の該当番号)	項目	2023年度 中間期末	2022年度 中間期末
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	8,825,792	
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 (△)	29,557	
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) (△)	15,448	
6	Tier 1 資本に係る調整項目の額 (貸倒引当金以外) (△)	18,003	
7	オン・バランス資産の額 (イ)	8,762,783	
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	8,651	
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	21,320	
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)	29,971	
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	6,466	
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)	6,466	
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	454,503	
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 (△)	364,074	
22	オフ・バランス取引に関する額 (ニ)	90,428	
連結レバレッジ比率 (5)			
23	資本の額 (ホ)	482,823	
24	総エクスポージャーの額 ((イ) + (ロ) + (ハ) + (ニ)) (ヘ)	8,889,650	
25	連結レバレッジ比率 ((ホ) / (ヘ))	5.43%	
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・バッファー比率		
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)	8,889,650	
	日本銀行に対する預け金の額	1,710,200	
	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')	10,599,851	
	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'))	4.55%	
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)	8,889,650	
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)	10,599,851	
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))	5.43%	
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))	4.55%	

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年度 中間期末	2022年度 中間期末
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		8,464,116
1a	1	連結貸借対照表における総資産の額		8,495,502
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 (△)		31,386
2	7	Tier1資本に係る調整項目の額 (△)		36,291
3		オン・バランス資産の額 (イ)		8,427,825
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		7,881
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		21,517
		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		17,514
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)		46,913
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		2,642
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)		2,642
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		439,487
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 (△)		356,547
19	6	オフ・バランス取引に関する額 (ニ)		82,939
連結レバレッジ比率				
20		資本の額 (ホ)		458,463
21	8	総エクスポージャーの額 ((イ) + (ロ) + (ハ) + (ニ)) (ヘ)		8,560,321
22		連結レバレッジ比率 ((ホ) / (ヘ))		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)		8,560,321
		日本銀行に対する預け金の額		1,485,537
		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')		10,045,859
		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'))		4.56%

2. 前中間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 (当該差異がある場合に限る。)

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

2023年度中間期末

(単位：百万円)

項番 (国際様式 (LR1) の該当番号)	項 目	2023年度 中間期末	2022年度 中間期末
1	貸借対照表における総資産の額	10,518,885	
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 (△)	1,710,200	
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	21,860	
8 a	デリバティブ取引等に関する額	29,975	
8 b	デリバティブ取引等に関連する資産の額 (△)	8,114	
9	レポ取引等に関する調整額	6,466	
9 a	レポ取引等に関する額	6,466	
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	90,397	
11	Tier 1 資本に係る調整項目の額 (貸倒引当金) (△)	16,732	
12	その他の調整項目	△ 48,994	
12 a	Tier 1 資本に係る調整項目の額 (貸倒引当金以外) (△)	11,182	
12 b	支払承諾見返勘定の額 (△)	8,255	
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 (△)	29,557	
13	総エクスポージャーの額	8,861,681	

項番 (国際様式 (LR2) の該当番号)	項目	2023年度 中間期末	2022年度 中間期末
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	8,792,314	
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 (△)	29,557	
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) (△)	16,732	
6	Tier 1 資本に係る調整項目の額 (貸倒引当金以外) (△)	11,182	
7	オン・バランス資産の額 (イ)	8,734,842	
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	8,651	
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	21,323	
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)	29,975	
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	6,466	
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)	6,466	
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	454,425	
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 (△)	364,027	
22	オフ・バランス取引に関する額 (ニ)	90,397	
単体レバレッジ比率 (5)			
23	資本の額 (ホ)	444,641	
24	総エクスポージャーの額 ((イ) + (ロ) + (ハ) + (ニ)) (ヘ)	8,861,681	
25	単体レバレッジ比率 ((ホ) / (ヘ))	5.01%	
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)	8,861,681	
	日本銀行に対する預け金の額	1,710,200	
	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')	10,571,882	
	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'))	4.20%	
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)	8,861,681	
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)	10,571,882	
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))	5.01%	
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))	4.20%	

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年度 中間期末	2022年度 中間期末
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		8,436,739
1a	1	貸借対照表における総資産の額		8,468,125
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 (△)		31,386
2	7	Tier1資本に係る調整項目の額 (△)		35,421
3		オン・バランス資産の額 (イ)		8,401,317
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		7,881
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		21,517
		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		17,514
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)		46,913
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		2,642
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)		2,642
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		439,449
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 (△)		356,528
19	6	オフ・バランス取引に関する額 (ニ)		82,920
単体レバレッジ比率				
20		資本の額 (ホ)		421,425
21	8	総エクスポージャーの額 ((イ) + (ロ) + (ハ) + (ニ)) (ヘ)		8,533,794
22		単体レバレッジ比率 ((ホ) / (ヘ))		4.93%
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)		8,533,794
		日本銀行に対する預け金の額		1,485,537
		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')		10,019,332
		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'))		4.20%

4. 前中間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。