

連結レバレッジ比率の構成に関する事項
(2020年6月末)

(別紙様式第六号)

(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	当四半期末 (2020年6月末)	前四半期末 (2020年3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	7,725,772	8,397,471
1a	1	連結貸借対照表における総資産の額	7,744,335	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 (△)	18,562	19,392
2	7	Tier 1 資本に係る調整項目の額 (△)	31,531	30,873
3		オン・バランス資産の額 (イ)	7,694,240	8,366,597
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		
		デリバティブ取引等に関する再構築コストの額	7,477	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	17,040	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	614	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)	25,132	27,591
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	-	-
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	2,620	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)	2,620	3,239
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	509,732	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変換調整の額 (△)	420,936	423,467
19	6	オフ・バランス取引に関する額 (ニ)	88,795	89,963
連結レバレッジ比率 (5)				
20		資本の額 (ホ)	477,428	454,548
21	8	総エクスポージャーの額 ((イ) + (ロ) + (ハ) + (ニ)) (ヘ)	7,810,789	8,487,393
22		連結レバレッジ比率 ((ホ) / (ヘ))	6.11%	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 (6)				
		総エクスポージャーの額 (ヘ)	7,810,789	
		日本銀行に対する預け金の額	1,118,861	
		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')	8,929,650	
		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'))	5.34%	

(前四半期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6月末の連結レバレッジ比率は、前四半期に対し+0.76%上昇し、6.11%となりました。

2019年金融庁告示第12号（以下、告示）において、2020年6月30日付告示改正に伴い、日本銀行に対する預け金の額が総エクスポージャーの額より除外されたことによるものとなっております。