

連結レバレッジ比率の構成に関する事項
(2020年9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9月末)	前四半期末 (2020年6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	7,853,123	7,725,772
1a	1	連結貸借対照表における総資産の額	7,873,042	7,744,335
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 (△)	19,918	18,562
2	7	Tier 1 資本に係る調整項目の額 (△)	29,800	31,531
3		オン・バランス資産の額 (イ)	7,823,323	7,694,240
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	8,736	7,477
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	17,433	17,040
		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	551	614
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)	26,721	25,132
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	4,103	2,620
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)	4,103	2,620
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	527,791	509,732
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 (△)	431,632	420,936
19	6	オフ・バランス取引に関する額 (ニ)	96,159	88,795
連結レバレッジ比率 (5)				
20		資本の額 (ホ)	485,199	477,428
21	8	総エクスポージャーの額 ((イ) + (ロ) + (ハ) + (ニ)) (ヘ)	7,950,308	7,810,789
22		連結レバレッジ比率 ((ホ) / (ヘ))	6.10%	6.11%
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)	7,950,308	7,810,789
		日本銀行に対する預け金の額	1,194,764	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')	9,145,072	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'))	5.30%	5.34%