

連結レバレッジ比率の構成に関する事項
(2023年9月末)

(別紙様式第六号 第一面)

(単位：百万円、%)

国際様式 (LR1) の 該当番号	項目	当四半期末 (2023年9月末)	前四半期末 (2023年6月末)
1	連結貸借対照表における総資産の額	10,552,363	10,752,887
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	1,977,834
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	19,169
8a	デリバティブ取引等に関する額	29,971	25,959
8b	デリバティブ取引等に関連する資産の額 (△)	8,114	6,789
9	レボ取引等に関する調整額	6,466	9,390
9a	レボ取引等に関する額	6,466	9,390
9b	レボ取引等に関する額 (△)	-	-
10	オフ・バランス取引に関する額	90,428	93,767
11	Tier1資本に係る調整項目の額 (貸倒引当金) (△)	15,448	14,962
12	その他の調整項目	△ 55,815	△ 48,811
12a	Tier1資本に係る調整項目の額 (貸倒引当金以外) (△)	18,003	17,737
12b	支払承諾見返勘定の額 (△)	8,255	8,069
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 (△)	29,557	23,003
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	8,889,650	8,833,607

連結レバレッジ比率の構成に関する事項
(2023年9月末)

(別紙様式第六号 第二面)

(単位: 百万円、%)

国際様式 (LR2) の 該当番号	項目	当四半期末 (2023年9月末)	前四半期末 (2023年6月末)
オン・バランス資産の額			
1	個別項目調整前のオン・バランス資産の額	8,825,792	8,760,194
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 (相殺した額に該当する部分に限る。)	-	-
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	23,003
4	レポ取引等により受領した証券の計上額 (△)	-	-
5	Tier1資本に係る調整項目の額 (貸倒引当金) (△)	15,448	14,962
6	Tier1資本に係る調整項目の額 (貸倒引当金以外) (△)	18,003	17,737
7	オン・バランス資産の額 (イ)	8,762,783	8,704,490
デリバティブ取引等に関する額			
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	6,781
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	19,177
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	25,959
レポ取引等に関する額			
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	9,390
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	9,390
オフ・バランス取引に関する額			
19	オフ・バランス取引の想定元本の額	454,503	459,578
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	365,810
22	オフ・バランス取引に関する額 (ニ)	90,428	93,767
連結レバレッジ比率			
23	資本の額 (ホ)	482,823	497,319
24	総エクスポージャーの額 ((イ) + (ロ) + (ハ) + (ニ)) (ヘ)	8,889,650	8,833,607
25	連結レバレッジ比率 ((ホ) / (ヘ))	5.43%	5.62%
26	適用する所要連結レバレッジ比率	3.00%	3.00%
27	適用する所要連結レバレッジ・バッファ率		
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			
	総エクスポージャーの額 (ヘ)	8,889,650	8,833,607
	日本銀行に対する預け金の額	1,710,200	1,977,834
	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	10,811,441
	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%	4.59%
平均値の開示			
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)	8,889,650	8,833,607
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)	10,599,851	10,811,441
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%	5.62%
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%	4.59%