

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

(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	2020年度中間期	2019年度中間期
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	5,528,040	6,083,745
1a	1	連結貸借対照表における総資産の額	5,569,248	6,126,137
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 (△)	41,208	42,392
2	7	Tier1 資本に係る調整項目の額 (△)	12,739	8,900
3		オン・バランス資産の額 (イ)	5,515,301	6,074,844
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	5,414	3,156
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	9,483	7,388
		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	9,366	10,751
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)	24,263	21,295
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	896	1,003
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)	896	1,003
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	1,027,082	955,246
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 (△)	871,196	812,295
19	6	オフ・バランス取引に関する額 (ニ)	155,886	142,950
連結レバレッジ比率				
20		資本の額 (ホ)	416,807	397,027
21	8	総エクスポージャーの額 ((イ) + (ロ) + (ハ) + (ニ)) (ヘ)	5,696,348	6,240,094
22		連結レバレッジ比率 ((ホ) / (ヘ))	7.31%	6.36%
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)	5,696,348	—
		日本銀行に対する預け金の額	1,145,211	—
		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´)	6,841,559	—
		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又は持株レバレッジ比率 ((ホ) / (ヘ´))	6.09%	—

(注)「国際様式の該当番号」とは、バーゼル銀行監督委員会により2014年1月12日に公表されたレバレッジ比率の枠組みと開示要件と題する文書の表1及び表2に記載された番号を指します。

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。)

連結レバレッジ比率は前期比0.95%増加しました。

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です。

3. 単体レバレッジ比率の構成に関する開示事項

(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	2020年度中間期	2019年度中間期
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	5,515,870	6,069,232
1a	1	貸借対照表における総資産の額	5,557,079	6,111,625
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 (△)	41,208	42,392
2	7	Tier1 資本に係る調整項目の額 (△)	13,594	9,783
3		オン・バランス資産の額 (イ)	5,502,276	6,059,449
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	5,414	3,156
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	9,483	7,388
		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	9,366	10,751
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)	24,263	21,295
レボ取引等に関する額				
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	896	1,003
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)	896	1,003
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	1,015,607	938,944
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 (△)	860,875	797,628
19	6	オフ・バランス取引に関する額 (ニ)	154,732	141,316
単体レバレッジ比率				
20		資本の額 (ホ)	403,539	381,711
21	8	総エクスポージャーの額 ((イ) + (ロ) + (ハ) + (ニ)) (ヘ)	5,682,168	6,223,065
22		単体レバレッジ比率 ((ホ) / (ヘ))	7.10%	6.13%
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)	5,682,168	—
		日本銀行に対する預け金の額	1,145,211	—
		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')	6,827,380	—
		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'))	5.91%	—

(注)「国際様式の該当番号」とは、バーゼル銀行監督委員会により2014年1月12日に公表されたレバレッジ比率の枠組みと開示要件と題する文書の表1及び表2に記載された番号を指します。

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(当該差異がある場合に限る。)

単体レバレッジ比率は前期比0.97%増加しました。

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です。