

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	2022年度中間期	2021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	5,929,858	5,706,636
1a	1	連結貸借対照表における総資産の額	6,012,096	5,749,178
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 (△)	82,238	42,542
2	7	Tier1 資本に係る調整項目の額 (△)	31,109	26,511
3		オン・バランス資産の額 (イ)	5,898,748	5,680,124
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	34,254	6,857
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	11,243	10,926
		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	17,773	5,784
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)	63,271	23,567
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	1,517	387
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)	1,517	387
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	1,056,525	1,050,386
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 (△)	878,875	885,775
19	6	オフ・バランス取引に関する額 (ニ)	177,650	164,611
連結レバレッジ比率				
20		資本の額 (ホ)	392,761	476,913
21	8	総エクスポージャーの額 ((イ) + (ロ) + (ハ) + (ニ)) (ヘ)	6,141,188	5,868,690
22		連結レバレッジ比率 ((ホ) / (ヘ))	6.39%	8.12%
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)	6,141,188	5,868,690
		日本銀行に対する預け金の額	855,427	1,676,695
		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´)	6,996,615	7,545,386
		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または持株レバレッジ比率 ((ホ) / (ヘ´))	5.61%	6.32%

(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および表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、前中間連結会計年度比1.73%低下しました。

主に「その他有価証券評価差額金」の減少により、資本の額が841億円減少したことが要因であります。

3. 単体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	2022年度中間期	2021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	5,910,730	5,683,818
1a	1	貸借対照表における総資産の額	5,992,968	5,726,361
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 (△)	82,238	42,542
2	7	Tier1 資本に係る調整項目の額 (△)	25,809	18,723
3		オン・バランス資産の額 (イ)	5,884,920	5,665,095
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	34,254	6,857
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	11,243	10,926
		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	17,773	5,784
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)	63,271	23,567
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	1,517	387
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)	1,517	387
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	1,049,474	1,040,752
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 (△)	872,534	877,107
19	6	オフ・バランス取引に関する額 (ニ)	176,940	163,644
単体レバレッジ比率				
20		資本の額 (ホ)	379,764	464,002
21	8	総エクスポージャーの額 ((イ) + (ロ) + (ハ) + (ニ)) (ヘ)	6,126,650	5,852,695
22		単体レバレッジ比率 ((ホ) / (ヘ))	6.19%	7.92%
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)	6,126,650	5,852,695
		日本銀行に対する預け金の額	855,427	1,676,695
		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')	6,982,077	7,529,391
		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'))	5.43%	6.16%

(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および表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、前中間事業年度比1.73%低下しました。

主に「その他有価証券評価差額金」の減少により、資本の額が842億円減少したことが要因であります。