

連結レバレッジ比率の構成に関する事項(2023年9月末連結レバレッジ比率)

(単位：百万円)

項番(国際様式(LR1)の該当番号)	項目	当中間期末 (2023年9月末)	前中間期末 (2022年9月末)
1	連結貸借対照表における総資産の額	13,389,482	
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(△)	1,840,820	
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	59,491	
8a	デリバティブ取引等に関する額	74,041	
8b	デリバティブ取引等に関連する資産の額(△)	14,549	
9	レボ取引等に関する調整額	-	
9a	レボ取引等に関する額	-	
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	371,939	
11	Tier1資本に係る調整項目の額(貸倒引当金)(△)	-	
12	その他の調整項目	△ 179,722	
12a	Tier1資本に係る調整項目の額(貸倒引当金以外)(△)	31,926	
12b	支払承諾見返勘定の額(△)	136,730	
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(△)	11,064	
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	11,800,370	

(単位：百万円、%)

項番 (国際様式 (LR2) の該当番号)	項目	当中間期末 (2023年9月末)	前中間期末 (2022年9月末)
オン・バランス資産の額 (1)			
1	個別項目調整前のオン・バランス資産の額	11,397,381	
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 (相殺した額に相当する部分に限る。)	-	
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 (△)	11,064	
4	レボ取引等により受領した証券の計上額 (△)	-	
5	Tier 1 資本に係る調整項目の額 (貸倒引当金) (△)	-	
6	Tier 1 資本に係る調整項目の額 (貸倒引当金以外) (△)	31,926	
7	オン・バランス資産の額 (イ)	11,354,390	
デリバティブ取引等に関する額 (2)			
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	14,999	
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	59,042	
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)	74,041	
レボ取引等に関する額 (3)			
14	レボ取引等に関する資産の額	-	
15	レボ取引等に関する資産の額から控除した額 (△)	-	
16	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	-	
17	代理取引のエクスポージャーの額	-	
18	レボ取引等に関する額 (ハ)	-	
オフ・バランス取引に関する額 (4)			
19	オフ・バランス取引の想定元本の額	2,074,654	
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 (△)	1,702,715	
22	オフ・バランス取引に関する額 (ニ)	371,939	
連結レバレッジ比率 (5)			
23	資本の額 (ホ)	1,004,773	
24	総エクスポージャーの額 ((イ) + (ロ) + (ハ) + (ニ)) (ヘ)	11,800,370	
25	連結レバレッジ比率 ((ホ) / (ヘ))	8.51%	
26	適用する所要連結レバレッジ比率	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 (6)			
	総エクスポージャーの額 (ヘ)	11,800,370	
	日本銀行に対する預け金の額	1,840,820	
	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')	13,641,191	
	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'))	7.36%	
平均値の開示 (7)			
28	レボ取引等に関する資産の額 (控除後) に係る平均値 ((ト) + (チ))	-	
	レボ取引等に関する資産の額に係る平均値 (ト)	-	
	レボ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	レボ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	レボ取引等に関する資産の額に係る四半期末の値 (リ)	-	
15	レボ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 (レボ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)	11,800,370	
30a	総エクスポージャーの額 (レボ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)	13,641,191	
31	連結レバレッジ比率 (レボ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))	8.51%	
31a	連結レバレッジ比率 (レボ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))	7.36%	

(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	当中間期末 (2023年9月末)	前中間期末 (2022年9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		11,286,824
1a	1	連結貸借対照表における総資産の額		11,465,287
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(△)		178,462
2	7	Tier 1 資本に係る調整項目の額 (△)		28,328
3		オン・バランス資産の額 (イ)		11,258,495
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		6,737
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		99,018
		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		26,133
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 (△)		5,277
8		清算会員である商工組合中央金庫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)		126,611
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		114
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)		114
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		2,035,393
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 (△)		1,633,483
19	6	オフ・バランス取引に関する額 (ニ)		401,909
連結レバレッジ比率 (5)				
20		資本の額 (ホ)		993,582
21	8	総エクスポージャーの額 ((イ) + (ロ) + (ハ) + (ニ)) (ヘ)		11,787,132
22		連結レバレッジ比率 ((ホ) / (ヘ))		8.42%
		適用する所要連結レバレッジ比率		3.00%
		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 (6)				
		総エクスポージャーの額 (ヘ)		11,787,132
		日本銀行に対する預け金の額		1,564,381
		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')		13,351,513
		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'))		7.44%

連結レバレッジ比率の構成に関する事項(2023年9月末連結レバレッジ比率)

(単位：百万円)

項番 (国際様式(LRI)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	13,389,482	13,270,116
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 (△)	1,840,820	1,794,598
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	59,491	46,855
8a	デリバティブ取引等に関する額	74,041	62,380
8b	デリバティブ取引等に関連する資産の額 (△)	14,549	15,525
9	レポ取引等に関する調整額	-	525
9a	レポ取引等に関する額	-	525
9b	レポ取引等に関する額 (△)	-	-
10	オフ・バランス取引に関する額	371,939	366,413
11	Tier1資本に係る調整項目の額 (貸倒引当金) (△)	-	-
12	その他の調整項目	△ 179,722	△ 170,733
12a	Tier1資本に係る調整項目の額 (貸倒引当金以外) (△)	31,926	30,660
12b	支払承諾見返勘定の額 (△)	136,730	136,859
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 (△)	11,064	3,214
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	11,800,370	11,718,578

(単位：百万円、%)

項番 (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)			
1	個別項目調整前のオン・バランス資産の額	11,397,381	11,323,133
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 (相殺した額に相当する部分に限る。)	-	-
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 (△)	11,064	3,214
4	レポ取引等により受領した証券の計上額 (△)	-	-
5	Tier 1 資本に係る調整項目の額 (貸倒引当金) (△)	-	-
6	Tier 1 資本に係る調整項目の額 (貸倒引当金以外) (△)	31,926	30,660
7	オン・バランス資産の額 (イ)	11,354,390	11,289,259
デリバティブ取引等に関する額 (2)			
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	14,999	11,561
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	59,042	50,819
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)	74,041	62,380
レポ取引等に関する額 (3)			
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	-	525
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)	-	525
オフ・バランス取引に関する額 (4)			
19	オフ・バランス取引の想定元本の額	2,074,654	2,069,179
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 (△)	1,702,715	1,702,766
22	オフ・バランス取引に関する額 (ニ)	371,939	366,413
連結レバレッジ比率 (5)			
23	資本の額 (ホ)	1,004,773	1,005,539
24	総エクスポージャーの額 ((イ) + (ロ) + (ハ) + (ニ)) (ヘ)	11,800,370	11,718,578
25	連結レバレッジ比率 ((ホ) / (ヘ))	8.51%	8.58%
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 (6)			
	総エクスポージャーの額 (ヘ)	11,800,370	11,718,578
	日本銀行に対する預け金の額	1,840,820	1,794,598
	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')	13,641,191	13,513,177
	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'))	7.36%	7.44%
平均値の開示 (7)			
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)	11,800,370	11,718,578
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)	13,641,191	13,513,177
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))	8.51%	8.58%
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))	7.36%	7.44%