

連結レバレッジ比率の構成に関する事項(2020年9月末連結レバレッジ比率)

(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 (2020年9月末)	前中間期末 (2019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	10,889,740	11,258,334
1a	1	連結貸借対照表における総資産の額	11,044,570	11,411,439
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 (△)	154,830	153,104
2	7	Tier 1 資本に係る調整項目の額 (△)	20,204	19,582
3		オン・バランス資産の額 (イ)	10,869,535	11,238,752
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	12,494	13,303
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	85,597	94,546
		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	29,265	30,128
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 (△)	3,766	6,430
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)	123,590	131,547
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	-	26
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)	-	26
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	1,860,657	1,638,104
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 (△)	1,495,728	1,304,808
19	6	オフ・バランス取引に関する額 (ニ)	364,929	333,295
連結レバレッジ比率 (5)				
20		資本の額 (ホ)	942,130	※1 946,269
21	8	総エクスポージャーの額 ((イ) + (ロ) + (ハ) + (ニ)) (ヘ)	11,358,056	11,703,621
22		連結レバレッジ比率 ((ホ) / (ヘ))	8.29%	8.08%
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)	11,358,056	
		日本銀行に対する預け金の額	1,838,405	
		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')	13,196,461	
		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'))	7.13%	

※1 危機対応準備金について、中間連結貸借対照表計上額から2019年6月20日定時株主総会決議に基づく減少予定額5,500百万円を控除しております。

※2 2020年9月末の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は、貸出金の増加を主因とする総エクスポージャーの額の増加により、前中間期末の連結レバレッジ比率に対し0.95%低下しております。

連結レバレッジ比率の構成に関する事項(2020年9月末連結レバレッジ比率)

(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	10,889,740	10,503,279
1a	1	連結貸借対照表における総資産の額	11,044,570	10,665,200
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 (△)	154,830	161,920
2	7	Tier 1 資本に係る調整項目の額 (△)	20,204	20,129
3		オン・バランス資産の額 (イ)	10,869,535	10,483,150
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	12,494	12,170
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	85,597	93,384
		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	29,265	36,474
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 (△)	3,766	3,824
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)	123,590	138,205
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	-	-
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)	-	-
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	1,860,657	1,781,336
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 (△)	1,495,728	1,429,771
19	6	オフ・バランス取引に関する額 (ニ)	364,929	351,564
連結レバレッジ比率 (5)				
20		資本の額 (ホ)	942,130	930,000
21	8	総エクスポージャーの額 ((イ) + (ロ) + (ハ) + (ニ)) (ヘ)	11,358,056	10,972,920
22		連結レバレッジ比率 ((ホ) / (ヘ))	8.29%	8.47%
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)	11,358,056	10,972,920
		日本銀行に対する預け金の額	1,838,405	1,583,361
		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')	13,196,461	12,556,282
		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'))	7.13%	7.40%