

単体レバレッジ比率の構成に関する事項(2020年9月末単体レバレッジ比率)

(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	10,821,169	11,186,332
	1a	1 貸借対照表における総資産の額	10,975,999	11,339,437
	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(△)	154,830	153,104
2	7	Tier 1 資本に係る調整項目の額 (△)	29,857	28,679
3		オン・バランス資産の額 (イ)	10,791,311	11,157,652
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		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 (△)	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
レポ取引等に関する額 (3)				
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	-	26
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)	-	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	1,884,481	1,661,537
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 (△)	1,517,169	1,325,899
19	6	オフ・バランス取引に関する額 (ニ)	367,311	335,638
単体レバレッジ比率 (5)				
20		資本の額 (ホ)	932,287	※1 938,051
21	8	総エクスポージャーの額 ((イ) + (ロ) + (ハ) + (ニ)) (ヘ)	11,282,214	11,624,865
22		単体レバレッジ比率 ((ホ) / (ヘ))	8.26%	8.06%
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 (6)				
		総エクスポージャーの額 (ヘ)	11,282,214	
		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')	13,120,619	
		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'))	7.10%	

※1 危機対応準備金について、中間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単体レバレッジ比率は、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、前中間期末の単体レバレッジ比率に対し0.96%低下しております。

単体レバレッジ比率の構成に関する事項(2020年9月末単体レバレッジ比率)

(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	10,821,169	10,433,089
	1a	1 貸借対照表における総資産の額	10,975,999	10,595,010
	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(△)	154,830	161,920
2	7	Tier 1 資本に係る調整項目の額 (△)	29,857	29,946
3		オン・バランス資産の額 (イ)	10,791,311	10,403,143
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		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 (△)	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
レポ取引等に関する額 (3)				
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	-	-
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)	-	-
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	1,884,481	1,806,118
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 (△)	1,517,169	1,452,075
19	6	オフ・バランス取引に関する額 (ニ)	367,311	354,042
単体レバレッジ比率 (5)				
20		資本の額 (ホ)	932,287	920,646
21	8	総エクスポージャーの額 ((イ) + (ロ) + (ハ) + (ニ)) (ヘ)	11,282,214	10,895,392
22		単体レバレッジ比率 ((ホ) / (ヘ))	8.26%	8.44%
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 (6)				
		総エクスポージャーの額 (ヘ)	11,282,214	10,895,392
		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')	13,120,619	12,478,753
		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'))	7.10%	7.37%