

連結レバレッジ比率の構成に関する事項(2021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 (2021年9月末)	前中間期末 (2020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	11,475,240	10,889,740
1a	1	連結貸借対照表における総資産の額	11,627,445	11,044,570
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 (△)	152,205	154,830
2	7	Tier 1 資本に係る調整項目の額 (△)	26,453	20,204
3		オン・バランス資産の額 (イ)	11,448,786	10,869,535
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	13,444	12,494
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	105,335	85,597
		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	18,067	29,265
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 (△)	1,155	3,766
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)	135,692	123,590
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	1,958,593	1,860,657
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 (△)	1,571,449	1,495,728
19	6	オフ・バランス取引に関する額 (ニ)	387,143	364,929
連結レバレッジ比率 (5)				
20		資本の額 (ホ)	965,492	942,130
21	8	総エクスポージャーの額 ((イ) + (ロ) + (ハ) + (ニ)) (ヘ)	11,971,622	11,358,056
22		連結レバレッジ比率 ((ホ) / (ヘ))	8.06%	8.29%
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)	11,971,622	11,358,056
		日本銀行に対する預け金の額	1,442,299	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')	13,413,922	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'))	7.19%	7.13%

連結レバレッジ比率の構成に関する事項(2021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 (2021年9月末)	前四半期末 (2021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	11,475,240	11,512,509
1a	1	連結貸借対照表における総資産の額	11,627,445	11,666,989
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 (△)	152,205	154,480
2	7	Tier 1 資本に係る調整項目の額 (△)	26,453	26,164
3		オン・バランス資産の額 (イ)	11,448,786	11,486,344
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	13,444	13,723
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	105,335	100,144
		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	18,067	20,056
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 (△)	1,155	1,494
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)	135,692	132,428
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	-	94
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)	-	94
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	1,958,593	1,953,440
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 (△)	1,571,449	1,570,944
19	6	オフ・バランス取引に関する額 (ニ)	387,143	382,496
連結レバレッジ比率 (5)				
20		資本の額 (ホ)	965,492	950,807
21	8	総エクスポージャーの額 ((イ) + (ロ) + (ハ) + (ニ)) (ヘ)	11,971,622	12,001,364
22		連結レバレッジ比率 ((ホ) / (ヘ))	8.06%	7.92%
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)	11,971,622	12,001,364
		日本銀行に対する預け金の額	1,442,299	1,413,769
		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')	13,413,922	13,415,133
		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'))	7.19%	7.08%