

連結レバレッジ比率の構成に関する事項(2021年12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12月末)	前四半期末 (2021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	11,656,766	11,475,240
1a	1	連結貸借対照表における総資産の額	11,815,288	11,627,445
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 (△)	158,522	152,205
2	7	Tier 1 資本に係る調整項目の額 (△)	27,984	26,453
3		オン・バランス資産の額 (イ)	11,628,782	11,448,786
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	14,214	13,444
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	107,152	105,335
		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	17,531	18,067
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 (△)	646	1,155
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)	138,252	135,692
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	1,969,223	1,958,593
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 (△)	1,581,919	1,571,449
19	6	オフ・バランス取引に関する額 (ニ)	387,303	387,143
連結レバレッジ比率 (5)				
20		資本の額 (ホ)	970,007	965,492
21	8	総エクスポージャーの額 ((イ) + (ロ) + (ハ) + (ニ)) (ヘ)	12,154,338	11,971,622
22		連結レバレッジ比率 ((ホ) / (ヘ))	7.98%	8.06%
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)	12,154,338	11,971,622
		日本銀行に対する預け金の額	1,243,268	1,442,299
		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')	13,397,606	13,413,922
		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'))	7.24%	7.19%