

連結レバレッジ比率の構成に関する事項(2022年3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	当期末 (2022年3月末)	前期末 (2021年3月末)
<b>オン・バランス資産の額 (1)</b>				
1		調整項目控除前のオン・バランス資産の額	11,164,023	11,327,858
1a	1	連結貸借対照表における総資産の額	11,315,676	11,480,236
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 (△)	151,652	152,378
2	7	Tier 1 資本に係る調整項目の額 (△)	26,367	25,726
3		オン・バランス資産の額 (イ)	11,137,656	11,302,132
<b>デリバティブ取引等に関する額 (2)</b>				
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	9,924	11,916
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	73,603	97,571
		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	15,453	23,271
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 (△)	1,729	2,232
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)	97,251	130,526
<b>レポ取引等に関する額 (3)</b>				
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	184	-
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)	184	-
<b>オフ・バランス取引に関する額 (4)</b>				
17		オフ・バランス取引の想定元本の額	2,021,231	1,929,424
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 (△)	1,625,882	1,549,009
19	6	オフ・バランス取引に関する額 (ニ)	395,348	380,414
<b>連結レバレッジ比率 (5)</b>				
20		資本の額 (ホ)	953,777	945,561
21	8	総エクスポージャーの額 ((イ) + (ロ) + (ハ) + (ニ)) (ヘ)	11,630,441	11,813,073
22		連結レバレッジ比率 ((ホ) / (ヘ))	8.20%	8.00%
<b>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)</b>				
		総エクスポージャーの額 (ヘ)	11,630,441	11,813,073
		日本銀行に対する預け金の額	1,472,029	1,603,035
		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')	13,102,471	13,416,108
		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'))	7.27%	7.04%

連結レバレッジ比率の構成に関する事項(2022年3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 (2022年3月末)	前四半期末 (2021年12月末)
<b>オン・バランス資産の額 (1)</b>				
1		調整項目控除前のオン・バランス資産の額	11,164,023	11,656,766
1a	1	連結貸借対照表における総資産の額	11,315,676	11,815,288
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 (△)	151,652	158,522
2	7	Tier 1 資本に係る調整項目の額 (△)	26,367	27,984
3		オン・バランス資産の額 (イ)	11,137,656	11,628,782
<b>デリバティブ取引等に関する額 (2)</b>				
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	9,924	14,214
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	73,603	107,152
		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	15,453	17,531
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 (△)	1,729	646
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)	97,251	138,252
<b>レボ取引等に関する額 (3)</b>				
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	184	-
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)	184	-
<b>オフ・バランス取引に関する額 (4)</b>				
17		オフ・バランス取引の想定元本の額	2,021,231	1,969,223
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 (△)	1,625,882	1,581,919
19	6	オフ・バランス取引に関する額 (ニ)	395,348	387,303
<b>連結レバレッジ比率 (5)</b>				
20		資本の額 (ホ)	953,777	970,007
21	8	総エクスポージャーの額 ((イ) + (ロ) + (ハ) + (ニ)) (ヘ)	11,630,441	12,154,338
22		連結レバレッジ比率 ((ホ) / (ヘ))	8.20%	7.98%
<b>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)</b>				
		総エクスポージャーの額 (ヘ)	11,630,441	12,154,338
		日本銀行に対する預け金の額	1,472,029	1,243,268
		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')	13,102,471	13,397,606
		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'))	7.27%	7.24%