

連結レバレッジ比率の構成に関する事項(2023年3月末連結レバレッジ比率)

(単位：百万円)

項番 (国際様式(LRI)の該当番号)	項目	当期末 (2023年3月末)	前期末 (2022年3月末)
1	連結貸借対照表における総資産の額	13,049,997	
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 (△)	-	
3	リスク移転の認識に係る要件を充足しない証券化エクスポージャーに係る調整	-	
4	中央銀行預け金に係る除外による調整 (△)	1,705,481	
5	顧客資産のうち、連結貸借対照表に計上されている金額 (△)		
6	有価証券の売買を約定日基準により会計処理している場合における調整項目	-	
7	キャッシュ・プーリング契約に基づく資金の移動に係る調整項目	-	
8	デリバティブ取引等に関する調整額	57,992	
8a	デリバティブ取引等に関する額	70,903	
8b	デリバティブ取引等に関連する資産の額 (△)	12,911	
9	レポ取引等に関する調整額	75	
9a	レポ取引等に関する額	75	
9b	レポ取引等に関する額 (△)	-	
10	オフ・バランス取引に関する額	361,561	
11	Tier1資本に係る調整項目の額 (貸倒引当金) (△)	-	
12	その他の調整項目	△ 166,363	
12a	Tier1資本に係る調整項目の額 (貸倒引当金以外) (△)	28,105	
12b	支払承諾見返勘定の額 (△)	131,426	
12c	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 (相殺した額に相当する部分に限る。)	-	
12d	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 (△)	6,832	
12e	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。)	-	
13	総エクスポージャーの額	11,597,782	

(単位：百万円、%)

項番 (国際様式 (LR2) の該当番号)	項目	当期末 (2023年3月末)	前期末 (2022年3月末)
オン・バランス資産の額 (1)			
1	個別項目調整前のオン・バランス資産の額	11,200,178	
2	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 (相殺した額に相当する部分に限る。)	-	
3	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 (△)	6,832	
4	レポ取引等により受領した証券の計上額 (△)	-	
5	Tier 1 資本に係る調整項目の額 (貸倒引当金) (△)	-	
6	Tier 1 資本に係る調整項目の額 (貸倒引当金以外) (△)	28,105	
7	オン・バランス資産の額 (イ)	11,165,241	
デリバティブ取引等に関する額 (2)			
8	デリバティブ取引等に関するRCの額に1.4を乗じた額	20,810	
9	デリバティブ取引等に関するPFEの額に1.4を乗じた額	50,093	
10	間接清算参加者に適格中央清算機関の債務履行を保証していない場合に零とした中央清算機関向けエクスポージャーの額 (△)	-	
11	クレジット・デリバティブ等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	-	
12	クレジット・デリバティブ等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 (△)	-	
13	デリバティブ取引等に関する額 (ロ)	70,903	
レポ取引等に関する額 (3)			
14	レポ取引等に関する資産の額	-	
15	レポ取引等に関する資産の額から控除した額 (△)	-	
16	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	75	
17	代理取引のエクスポージャーの額	-	
18	レポ取引等に関する額 (ハ)	75	
オフ・バランス取引に関する額 (4)			
19	オフ・バランス取引の想定元本の額	2,039,528	
20	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 (△)	1,677,967	
22	オフ・バランス取引に関する額 (ニ)	361,561	
連結レバレッジ比率 (5)			
23	資本の額 (ホ)	998,743	
24	総エクスポージャーの額 ((イ) + (ロ) + (ハ) + (ニ)) (ヘ)	11,597,782	
25	連結レバレッジ比率 ((ホ) / (ヘ))	8.61%	
26	適用する所要連結レバレッジ比率	3.00%	
27	適用する所要連結レバレッジ・バッファ率	-	
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)	11,597,782	
	日本銀行に対する預け金の額	1,705,481	
	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')	13,303,263	
	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'))	7.50%	
平均値の開示 (7)			
28	レポ取引等に関する資産の額 (控除後) に係る平均値 ((ト) + (チ))	-	
	レポ取引等に関する資産の額に係る平均値 (ト)	-	
	レポ取引等に関する資産の額から控除した額に係る平均値 (△) (チ)	-	
29	レポ取引等に関する資産の額 (控除後) に係る四半期末の値 ((リ) + (ヌ))	-	
14	レポ取引等に関する資産の額に係る四半期末の値 (リ)	-	
15	レポ取引等に関する資産の額から控除した額に係る四半期末の値 (△) (ヌ)	-	
30	総エクスポージャーの額 (レポ取引等に関する資産の額 (控除後) に係る平均値を使用し、日本銀行に対する預け金を算入しない場合) (ル)	11,597,782	
30a	総エクスポージャーの額 (レポ取引等に関する資産の額 (控除後) に係る平均値を使用し、日本銀行に対する預け金を算入する場合) (ヲ)	13,303,263	
31	連結レバレッジ比率 (レポ取引等に関する資産の額 (控除後) に係る平均値を使用し、日本銀行に対する預け金を算入しない場合) ((ホ) / (ル))	8.61%	
31a	連結レバレッジ比率 (レポ取引等に関する資産の額 (控除後) に係る平均値を使用し、日本銀行に対する預け金を算入する場合) ((ホ) / (ヲ))	7.50%	

(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 (2023年3月末)	前期末 (2022年3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		11,164,023
1a	1	連結貸借対照表における総資産の額		11,315,676
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
2	7	Tier 1 資本に係る調整項目の額 (△)		26,367
3		オン・バランス資産の額 (イ)		11,137,656
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		9,924
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
		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
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
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
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		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
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		2,021,231
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
19	6	オフ・バランス取引に関する額 (ニ)		395,348
連結レバレッジ比率 (5)				
20		資本の額 (ホ)		953,777
21	8	総エクスポージャーの額 ((イ) + (ロ) + (ハ) + (ニ)) (ヘ)		11,630,441
22		連結レバレッジ比率 ((ホ) / (ヘ))		8.20%
		適用する所要連結レバレッジ比率		3.00%
		適用する所要連結レバレッジ・バッファ率		-
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)		11,630,441
		日本銀行に対する預け金の額		1,472,029
		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
		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%

連結レバレッジ比率の構成に関する事項(2023年3月末連結レバレッジ比率)

(単位：百万円)

項番 (国際様式(LRI)の該当番号)	項目	当四半期末 (2023年3月末)	前四半期末 (2022年12月末)
1	連結貸借対照表における総資産の額	13,049,997	
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 (△)	-	
3	リスク移転の認識に係る要件を充足しない証券化エクスポージャーに係る調整	-	
4	中央銀行預け金に係る除外による調整 (△)	1,705,481	
5	顧客資産のうち、連結貸借対照表に計上されている金額 (△)		
6	有価証券の売買を約定日基準により会計処理している場合における調整項目	-	
7	キャッシュ・プーリング契約に基づく資金の移動に係る調整項目	-	
8	デリバティブ取引等に関する調整額	57,992	
8a	デリバティブ取引等に関する額	70,903	
8b	デリバティブ取引等に関連する資産の額 (△)	12,911	
9	レポ取引等に関する調整額	75	
9a	レポ取引等に関する額	75	
9b	レポ取引等に関する額 (△)	-	
10	オフ・バランス取引に関する額	361,561	
11	Tier1資本に係る調整項目の額 (貸倒引当金) (△)	-	
12	その他の調整項目	△ 166,363	
12a	Tier1資本に係る調整項目の額 (貸倒引当金以外) (△)	28,105	
12b	支払承諾見返勘定の額 (△)	131,426	
12c	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 (相殺した額に相当する部分に限る。)	-	
12d	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 (△)	6,832	
12e	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。)	-	
13	総エクスポージャーの額	11,597,782	

(単位：百万円、%)

項番 (国際様式 (LR2) の該当番号)	項目	当四半期末 (2023年3月末)	前四半期末 (2022年12月末)
オン・バランス資産の額 (1)			
1	個別項目調整前のオン・バランス資産の額	11,200,178	
2	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 (相殺した額に相当する部分に限る。)	-	
3	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 (△)	6,832	
4	レポ取引等により受領した証券の計上額 (△)	-	
5	Tier 1 資本に係る調整項目の額 (貸倒引当金) (△)	-	
6	Tier 1 資本に係る調整項目の額 (貸倒引当金以外) (△)	28,105	
7	オン・バランス資産の額 (イ)	11,165,241	
デリバティブ取引等に関する額 (2)			
8	デリバティブ取引等に関するRCの額に1.4を乗じた額	20,810	
9	デリバティブ取引等に関するPFEの額に1.4を乗じた額	50,093	
10	間接清算参加者に適格中央清算機関の債務履行を保証していない場合に零とした中央清算機関向けエクスポージャーの額 (△)	-	
11	クレジット・デリバティブ等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	-	
12	クレジット・デリバティブ等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 (△)	-	
13	デリバティブ取引等に関する額 (ロ)	70,903	
レポ取引等に関する額 (3)			
14	レポ取引等に関する資産の額	-	
15	レポ取引等に関する資産の額から控除した額 (△)	-	
16	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	75	
17	代理取引のエクスポージャーの額	-	
18	レポ取引等に関する額 (ハ)	75	
オフ・バランス取引に関する額 (4)			
19	オフ・バランス取引の想定元本の額	2,039,528	
20	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 (△)	1,677,967	
22	オフ・バランス取引に関する額 (ニ)	361,561	
連結レバレッジ比率 (5)			
23	資本の額 (ホ)	998,743	
24	総エクスポージャーの額 ((イ) + (ロ) + (ハ) + (ニ)) (ヘ)	11,597,782	
25	連結レバレッジ比率 ((ホ) / (ヘ))	8.61%	
26	適用する所要連結レバレッジ比率	3.00%	
27	適用する所要連結レバレッジ・バッファ率	-	
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)	11,597,782	
	日本銀行に対する預け金の額	1,705,481	
	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')	13,303,263	
	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'))	7.50%	
平均値の開示 (7)			
28	レポ取引等に関する資産の額 (控除後) に係る平均値 ((ト) + (チ))	-	
	レポ取引等に関する資産の額に係る平均値 (ト)	-	
	レポ取引等に関する資産の額から控除した額に係る平均値 (△) (チ)	-	
29	レポ取引等に関する資産の額 (控除後) に係る四半期末の値 ((リ) + (ヌ))	-	
14	レポ取引等に関する資産の額に係る四半期末の値 (リ)	-	
15	レポ取引等に関する資産の額から控除した額に係る四半期末の値 (△) (ヌ)	-	
30	総エクスポージャーの額 (レポ取引等に関する資産の額 (控除後) に係る平均値を使用し、日本銀行に対する預け金を算入しない場合) (ル)	11,597,782	
30a	総エクスポージャーの額 (レポ取引等に関する資産の額 (控除後) に係る平均値を使用し、日本銀行に対する預け金を算入する場合) (ヲ)	13,303,263	
31	連結レバレッジ比率 (レポ取引等に関する資産の額 (控除後) に係る平均値を使用し、日本銀行に対する預け金を算入しない場合) ((ホ) / (ル))	8.61%	
31a	連結レバレッジ比率 (レポ取引等に関する資産の額 (控除後) に係る平均値を使用し、日本銀行に対する預け金を算入する場合) ((ホ) / (ヲ))	7.50%	

(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 (2023年3月末)	前四半期末 (2022年12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		11,321,498
1a	1	連結貸借対照表における総資産の額		11,518,514
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(△)		197,016
2	7	Tier1 資本に係る調整項目の額 (△)		29,524
3		オン・バランス資産の額 (イ)		11,291,974
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		13,858
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		102,732
		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		38,279
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 (△)		12,916
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)		141,954
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		97
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)		97
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		2,002,853
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 (△)		1,608,680
19	6	オフ・バランス取引に関する額 (ニ)		394,172
連結レバレッジ比率 (5)				
20		資本の額 (ホ)		995,789
21	8	総エクスポージャーの額 ((イ) + (ロ) + (ハ) + (ニ)) (ヘ)		11,828,198
22		連結レバレッジ比率 ((ホ) / (ヘ))		8.41%
		適用する所要連結レバレッジ比率		3.00%
		適用する所要連結レバレッジ・バッファ率		-
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)		11,828,198
		日本銀行に対する預け金の額		1,509,482
		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')		13,337,681
		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'))		7.46%