

連結レバレッジ比率の構成に関する事項(2024年3月末連結レバレッジ比率)

(単位：百万円)

項番(国際様式(LR1)の該当番号)	項目	当期末 (2024年3月末)	前期末 (2023年3月末)
1	連結貸借対照表における総資産の額	13,308,663	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(△)	1,612,722	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	52,912	57,992
8a	デリバティブ取引等に関する額	67,990	70,903
8b	デリバティブ取引等に関連する資産の額(△)	15,077	12,911
9	レボ取引等に関する調整額	439	75
9a	レボ取引等に関する額	439	75
9b	レボ取引等に関する額(△)	-	-
10	オフ・バランス取引に関する額	238,842	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	△ 199,843	△ 166,363
12a	Tier1資本に係る調整項目の額(貸倒引当金以外)(△)	49,032	28,105
12b	支払承諾見返勘定の額(△)	143,441	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(△)	7,369	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	11,788,292	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 (2024年3月末)	前期末 (2023年3月末)
<b>オン・バランス資産の額 (1)</b>			
1	個別項目調整前のオン・バランス資産の額	11,537,421	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 (△)	7,369	6,832
4	レボ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) (△)	49,032	28,105
7	オン・バランス資産の額 (イ)	11,481,020	11,165,241
<b>デリバティブ取引等に関する額 (2)</b>			
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	15,890	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	52,099	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)	67,990	70,903
<b>レボ取引等に関する額 (3)</b>			
14	レボ取引等に関する資産の額	-	-
15	レボ取引等に関する資産の額から控除した額 (△)	-	-
16	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	439	75
17	代理取引のエクスポージャーの額	-	-
18	レボ取引等に関する額 (ハ)	439	75
<b>オフ・バランス取引に関する額 (4)</b>			
19	オフ・バランス取引の想定元本の額	639,871	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 (△)	401,028	1,677,967
22	オフ・バランス取引に関する額 (ニ)	238,842	361,561
<b>連結レバレッジ比率 (5)</b>			
23	資本の額 (ホ)	1,040,798	998,743
24	総エクスポージャーの額 (イ) + (ロ) + (ハ) + (ニ) (ヘ)	11,788,292	11,597,782
25	連結レバレッジ比率 (ホ) / (ヘ)	8.82%	8.61%
26	適用する所要連結レバレッジ比率	3.00%	3.00%
27	適用する所要連結レバレッジ・バッファ率	-	-
<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)	11,788,292	11,597,782
	日本銀行に対する預け金の額	1,612,722	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')	13,401,014	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'))	7.76%	7.50%
<b>平均値の開示 (7)</b>			
28	レボ取引等に関する資産の額 (控除後) に係る平均値 (ト) + (チ)	-	-
	レボ取引等に関する資産の額に係る平均値 (ト)	-	-
	レボ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	レボ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	レボ取引等に関する資産の額に係る四半期末の値 (リ)	-	-
15	レボ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 (レボ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)	11,788,292	11,597,782
30a	総エクスポージャーの額 (レボ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)	13,401,014	13,303,263
31	連結レバレッジ比率 (レボ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)	8.82%	8.61%
31a	連結レバレッジ比率 (レボ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)	7.76%	7.50%

※ 2023年3月末から2023年12月末までの総エクスポージャーの額について、算定に用いる数値が一部誤っていることが判明しましたのでお詫び申し上げます。なお、レバレッジ比率への影響は極めて軽微であることから公表済の数値の修正は行わないことといたします。

連結レバレッジ比率の構成に関する事項(2024年3月末連結レバレッジ比率)

(単位：百万円)

項番(国際様式(LR1)の該当番号)	項目	当四半期末 (2024年3月末)	前四半期末 (2023年12月末)
1	連結貸借対照表における総資産の額	13,308,663	13,141,762
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(△)	1,612,722	1,604,927
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	52,912	54,532
8a	デリバティブ取引等に関する額	67,990	68,799
8b	デリバティブ取引等に関連する資産の額(△)	15,077	14,266
9	レボ取引等に関する調整額	439	855
9a	レボ取引等に関する額	439	855
9b	レボ取引等に関する額(△)	-	-
10	オフ・バランス取引に関する額	238,842	364,389
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	△ 199,843	△ 180,877
12a	Tier1資本に係る調整項目の額(貸倒引当金以外)(△)	49,032	33,581
12b	支払承諾見返勘定の額(△)	143,441	141,844
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(△)	7,369	5,451
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	11,788,292	11,775,735

(単位：百万円、%)

項番 (国際様式 (LR2) の該当番号)	項目	当四半期末 (2024年3月末)	前四半期末 (2023年12月末)
<b>オン・バランス資産の額 (1)</b>			
1	個別項目調整前のオン・バランス資産の額	11,537,421	11,380,723
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 (△)	7,369	5,451
4	レボ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) (△)	49,032	33,581
7	オン・バランス資産の額 (イ)	11,481,020	11,341,690
<b>デリバティブ取引等に関する額 (2)</b>			
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	15,890	17,349
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	52,099	51,449
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)	67,990	68,799
<b>レボ取引等に関する額 (3)</b>			
14	レボ取引等に関する資産の額	-	-
15	レボ取引等に関する資産の額から控除した額 (△)	-	-
16	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	439	855
17	代理取引のエクスポージャーの額	-	-
18	レボ取引等に関する額 (ハ)	439	855
<b>オフ・バランス取引に関する額 (4)</b>			
19	オフ・バランス取引の想定元本の額	639,871	2,053,128
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 (△)	401,028	1,688,738
22	オフ・バランス取引に関する額 (ニ)	238,842	364,389
<b>連結レバレッジ比率 (5)</b>			
23	資本の額 (ホ)	1,040,798	1,022,230
24	総エクスポージャーの額 ((イ) + (ロ) + (ハ) + (ニ)) (ヘ)	11,788,292	11,775,735
25	連結レバレッジ比率 ((ホ) / (ヘ))	8.82%	8.68%
26	適用する所要連結レバレッジ比率	3.00%	3.00%
27	適用する所要連結レバレッジ・バッファ率	-	-
<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)	11,788,292	11,775,735
	日本銀行に対する預け金の額	1,612,722	1,604,927
	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')	13,401,014	13,380,662
	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'))	7.76%	7.63%
<b>平均値の開示 (7)</b>			
28	レボ取引等に関する資産の額 (控除後) に係る平均値 ((ト) + (チ))	-	-
	レボ取引等に関する資産の額に係る平均値 (ト)	-	-
	レボ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	レボ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	レボ取引等に関する資産の額に係る四半期末の値 (リ)	-	-
15	レボ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 (レボ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)	11,788,292	11,775,735
30a	総エクスポージャーの額 (レボ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)	13,401,014	13,380,662
31	連結レバレッジ比率 (レボ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))	8.82%	8.68%
31a	連結レバレッジ比率 (レボ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))	7.76%	7.63%

※ 2023年3月末から2023年12月末までの総エクスポージャーの額について、算定に用いる数値が一部誤っていることが判明しましたのでお詫び申し上げます。なお、レバレッジ比率への影響は極めて軽微であることから公表済の数値の修正は行わないことといたします。