

連結レバレッジ比率の構成に関する事項(2020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 (2020年3月末)	前期末 (2019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	11,051,440	11,668,634
1a	1	連結貸借対照表における総資産の額	11,219,507	11,818,536
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 (△)	168,067	149,901
2	7	Tier 1 資本に係る調整項目の額 (△)	19,268	18,459
3		オン・バランス資産の額 (イ)	11,032,172	11,650,175
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	12,610	12,155
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	97,183	95,865
		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	41,258	30,544
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 (△)	4,534	5,443
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)	146,518	133,122
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	1,721,476	1,609,681
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 (△)	1,374,169	1,276,108
19	6	オフ・バランス取引に関する額 (ニ)	347,306	333,572
連結レバレッジ比率 (5)				
20		資本の額 (ホ)	931,803	937,323
21	8	総エクスポージャーの額 ((イ) + (ロ) + (ハ) + (ニ)) (ヘ)	11,525,997	12,116,870
22		連結レバレッジ比率 ((ホ) / (ヘ))	8.08%	7.73%

連結レバレッジ比率の構成に関する事項(2020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 (2020年3月末)	前四半期末 (2019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	11,051,440	11,248,120
1a	1	連結貸借対照表における総資産の額	11,219,507	11,403,844
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 (△)	168,067	155,723
2	7	Tier 1 資本に係る調整項目の額 (△)	19,268	19,988
3		オン・バランス資産の額 (イ)	11,032,172	11,228,132
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	12,610	11,528
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	97,183	97,369
		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	41,258	30,058
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 (△)	4,534	3,874
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)	146,518	135,081
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	-	2
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)	-	2
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	1,721,476	1,655,173
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 (△)	1,374,169	1,317,740
19	6	オフ・バランス取引に関する額 (ニ)	347,306	337,432
連結レバレッジ比率 (5)				
20		資本の額 (ホ)	931,803	※ 949,181
21	8	総エクスポージャーの額 ((イ) + (ロ) + (ハ) + (ニ)) (ヘ)	11,525,997	11,700,648
22		連結レバレッジ比率 ((ホ) / (ヘ))	8.08%	8.11%

※危機対応準備金について、四半期連結貸借対照表計上額から2019年6月20日定時株主総会決議に基づく減少予定額5,500百万円を控除しております。