

単体レバレッジ比率の構成に関する事項(2020年3月末単体レバレッジ比率)

(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	10,981,280	11,599,929
	1a	1 貸借対照表における総資産の額	11,149,348	11,749,830
	1b	3 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 (△)	29,182	28,187
3		オン・バランス資産の額 (イ)	10,952,098	11,571,741
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		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		
		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	1,745,198	1,633,178
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 (△)	1,395,520	1,297,256
19	6	オフ・バランス取引に関する額 (ニ)	349,678	335,922
単体レバレッジ比率 (5)				
20		資本の額 (ホ)	922,914	929,619
21	8	総エクスポージャーの額 ((イ) + (ロ) + (ハ) + (ニ)) (ヘ)	11,448,295	12,040,786
22		単体レバレッジ比率 ((ホ) / (ヘ))	8.06%	7.72%

単体レバレッジ比率の構成に関する事項(2020年3月末単体レバレッジ比率)

(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	10,981,280	11,175,476
1a	1	貸借対照表における総資産の額	11,149,348	11,331,199
1b	3	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 (△)	29,182	28,748
3		オン・バランス資産の額 (イ)	10,952,098	11,146,728
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		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		
		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	1,745,198	1,679,461
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 (△)	1,395,520	1,339,600
19	6	オフ・バランス取引に関する額 (ニ)	349,678	339,861
単体レバレッジ比率 (5)				
20		資本の額 (ホ)	922,914	※ 940,597
21	8	総エクスポージャーの額 ((イ) + (ロ) + (ハ) + (ニ)) (ヘ)	11,448,295	11,621,673
22		単体レバレッジ比率 ((ホ) / (ヘ))	8.06%	8.09%

※危機対応準備金について、四半期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。