

連結レバレッジ比率の構成に関する事項(2020年12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12月末)	前四半期末 (2020年9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	11,480,193	10,889,740
1a	1	連結貸借対照表における総資産の額	11,631,634	11,044,570
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 (△)	151,441	154,830
2	7	Tier 1 資本に係る調整項目の額 (△)	20,677	20,204
3		オン・バランス資産の額 (イ)	11,459,515	10,869,535
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	13,011	12,494
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	82,592	85,597
		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	26,259	29,265
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 (△)	3,841	3,766
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)	118,022	123,590
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	-	-
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)	-	-
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	1,871,450	1,860,657
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 (△)	1,505,640	1,495,728
19	6	オフ・バランス取引に関する額 (ニ)	365,810	364,929
連結レバレッジ比率 (5)				
20		資本の額 (ホ)	948,295	942,130
21	8	総エクスポージャーの額 ((イ) + (ロ) + (ハ) + (ニ)) (ヘ)	11,943,348	11,358,056
22		連結レバレッジ比率 ((ホ) / (ヘ))	7.93%	8.29%
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)	11,943,348	11,358,056
		日本銀行に対する預け金の額	1,269,892	1,838,405
		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')	13,213,241	13,196,461
		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'))	7.17%	7.13%