

連結レバレッジ比率の構成に関する事項(2020年6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6月末)	前四半期末 (2020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	10,503,279	11,051,440
1a	1	連結貸借対照表における総資産の額	10,665,200	11,219,507
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 (△)	161,920	168,067
2	7	Tier 1 資本に係る調整項目の額 (△)	20,129	19,268
3		オン・バランス資産の額 (イ)	10,483,150	11,032,172
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	12,170	12,610
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	93,384	97,183
		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	36,474	41,258
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 (△)	3,824	4,534
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)	138,205	146,518
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	1,781,336	1,721,476
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 (△)	1,429,771	1,374,169
19	6	オフ・バランス取引に関する額 (ニ)	351,564	347,306
連結レバレッジ比率 (5)				
20		資本の額 (ホ)	930,000	931,803
21	8	総エクスポージャーの額 ((イ) + (ロ) + (ハ) + (ニ)) (ヘ)	10,972,920	11,525,997
22		連結レバレッジ比率 ((ホ) / (ヘ))	8.47%	8.08%
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)	10,972,920	
		日本銀行に対する預け金の額	1,583,361	
		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')	12,556,282	
		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'))	7.40%	

(注) 2020年6月末の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は、貸出金の増加を主因とする総エクスポージャーの額の増加により、前四半期末の連結レバレッジ比率に対し0.68%低下しております。