

## 連結レバレッジ比率の構成に関する開示事項(2023年6月末)

(単位:百万円)

項番(国際 様式(LR1)の 該当番号)	項目	2023年6月末	2023年3月末
1	連結貸借対照表における総資産の額	105,344,905	94,504,944
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(△)	20,176,384	21,241,013
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	527,611	339,915
8a	デリバティブ取引等に関する額	726,830	624,058
8b	デリバティブ取引等に関連する資産の額(△)	199,219	284,142
9	レポ取引等に関する調整額	875,837	701,482
9a	レポ取引等に関する額	1,095,282	1,103,316
9b	レポ取引等に関する額(△)	219,445	401,833
10	オフ・バランス取引に関する額	4,440,011	4,167,238
11	Tier1 資本に係る調整項目の額(貸倒引当金)(△)	10,218	-
12	その他の調整項目	4,781,405	3,437,272
12a	Tier1 資本に係る調整項目の額(貸倒引当金以外)(△)	197,957	195,615
12b	支払承諾見返勘定の額(△)	3,286,734	3,197,577
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(相殺され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(△)	1,296,714	44,080
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	86,220,357	75,035,295

## 連結レバレッジ比率の構成に関する開示事項(2023年6月末)

(単位:百万円、%)

項番(国際様式(LR2)の該当番号)	項目	2023年6月末	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	81,463,123	69,380,377
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(Δ)	1,296,714	44,080
4	レボ取引等により受領した証券の計上額(Δ)	-	-
5	Tier1 資本に係る調整項目の額(貸倒引当金)(Δ)	10,218	-
6	Tier1 資本に係る調整項目の額(貸倒引当金以外)(Δ)	197,957	195,615
7	オン・バランス資産の額 (イ)	79,958,232	69,140,682
<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	220,683	168,824
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	506,147	455,234
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(Δ)	-	-
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(Δ)	-	-
13	デリバティブ取引等に関する額 (ロ)	726,830	624,058
<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	3,646,334	3,938,209
15	レボ取引等に関する資産の額から控除した額(Δ)	3,426,889	3,536,375
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	875,837	701,482
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)	1,095,282	1,103,316
<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	6,536,287	6,103,240
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(Δ)	2,096,275	1,936,001
22	オフ・バランス取引に関する額 (ニ)	4,440,011	4,167,238
<b>連結レバレッジ比率 (5)</b>			
23	資本の額 (ホ)	6,526,705	6,653,992
24	総エクスポージャーの額((イ)+(ロ)+(ハ)+(ニ)) (ヘ)	86,220,357	75,035,295
25	連結レバレッジ比率((ホ)/(ヘ))	7.56%	8.86%
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)	86,220,357	75,035,295
	日本銀行に対する預け金の額	20,176,384	21,241,013
	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')	106,396,741	96,276,309
	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'))	6.13%	6.91%
<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))	259,873	112,994
	レボ取引等に関する資産の額に係る平均値 (ト)	3,666,246	3,795,755
	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(Δ) (チ)	3,406,373	3,682,761
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))	219,445	401,833
14	レボ取引等に関する資産の額に係る四半期末の値 (リ)	3,646,334	3,938,209
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(Δ) (ヌ)	3,426,889	3,536,375
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)	86,260,786	74,746,456
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)	106,437,170	95,987,469
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))	7.56%	8.90%
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))	6.13%	6.93%

## 「前四半期末の連結レバレッジ比率との間に著しい差異を生じた原因」

市場運用資産増加によるオン・バランス資産増加を主因に比率が下落したものを。