

単体レバレッジ比率の構成に関する開示事項(2020年12月末)

(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	2020年 12月末	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	86,376,849	85,135,010
1a	1	貸借対照表における総資産の額	87,114,367	85,597,893
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(Δ)	737,518	462,882
2	7	Tier1 資本に係る調整項目の額(Δ)	133,234	114,912
3		オン・バランス資産の額 (イ)	86,243,614	85,020,097
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	45,004	30,152
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	433,564	435,067
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	-	-
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(Δ)	147,539	95,166
8		清算会員である農林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(Δ)		
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(Δ)	-	-
11	4	デリバティブ取引等に関する額 (ロ)	331,028	370,053
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	356,785	112,956
13		レボ取引等に関する資産の額から控除した額(Δ)	-	-
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	831,019	558,062
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)	1,187,805	671,018
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	3,215,724	2,957,537
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(Δ)	2,077,782	1,884,339
19	6	オフ・バランス取引に関する額 (ニ)	1,137,942	1,073,198
単体レバレッジ比率 (5)				
20		資本の額 (ホ)	9,616,382	9,478,741
21	8	総エクスポージャーの額((イ)+(ロ)+(ハ)+(ニ)) (ヘ)	88,900,391	87,134,368
22		単体レバレッジ比率((ホ)/(ヘ))	10.81%	10.87%
日本銀行に対する預け金を算入する場合の単体レバレッジ比率 (6)				
		総エクスポージャーの額 (ヘ)	88,900,391	87,134,368
		日本銀行に対する預け金の額	18,321,904	18,940,112
		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')	107,222,296	106,074,480
		日本銀行に対する預け金を算入する場合の単体レバレッジ比率((ホ)/(ヘ'))	8.96%	8.93%