

農林中央金庫

連結レバレッジ比率の構成に関する開示事項(2023年3月末)

(単位:百万円)

項番(国際様式(LR1)の該当番号)	項目	2023年3月末	2022年12月末
1	連結貸借対照表における総資産の額	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(△)	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	339,915	
8a	デリバティブ取引等に関する額	624,058	
8b	デリバティブ取引等に関連する資産の額(△)	284,142	
9	レポ取引等に関する調整額	701,482	
9a	レポ取引等に関する額	1,103,316	
9b	レポ取引等に関する額(△)	401,833	
10	オフ・バランス取引に関する額	4,167,238	
11	Tier1 資本に係る調整項目の額(貸倒引当金)(△)	-	
12	その他の調整項目	3,437,272	
12a	Tier1 資本に係る調整項目の額(貸倒引当金以外)(△)	195,615	
12b	支払承諾見返勘定の額(△)	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(△)	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	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3月末)

(単位:百万円、%)

項番(国際様式(LR2)の該当番号)	項目	2023年3月末	2022年12月末
オン・バランス資産の額 (1)			
1	個別項目調整前のオン・バランス資産の額	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(△)	44,080	
4	レボ取引等により受領した証券の計上額(△)	-	
5	Tier1 資本に係る調整項目の額(貸倒引当金)(△)	-	
6	Tier1 資本に係る調整項目の額(貸倒引当金以外)(△)	195,615	
7	オン・バランス資産の額 (イ)	69,140,682	
デリバティブ取引等に関する額 (2)			
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	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	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(△)	-	
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(△)	-	
13	デリバティブ取引等に関する額 (ロ)	624,058	
レボ取引等に関する額 (3)			
14	レボ取引等に関する資産の額	3,938,209	
15	レボ取引等に関する資産の額から控除した額(△)	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	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)	1,103,316	
オフ・バランス取引に関する額(4)			
19	オフ・バランス取引の想定元本の額	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(△)	1,936,001	
22	オフ・バランス取引に関する額 (ニ)	4,167,238	
連結レバレッジ比率 (5)			
23	資本の額 (ホ)	6,653,992	
24	総エクスポージャーの額((イ)+(ロ)+(ハ)+(ニ)) (ヘ)	75,035,295	
25	連結レバレッジ比率((ホ)/(ヘ))	8.86%	
26	適用する所要連結レバレッジ比率	3.00%	
27	適用する連結レバレッジ・バッファ比率	-	
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)	75,035,295	
	日本銀行に対する預け金の額	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')	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'))	6.91%	
平均値の開示 (7)			
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))	112,994	
	レボ取引等に関する資産の額に係る平均値 (ト)	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(△) (チ)	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))	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)	3,938,209	
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(△) (ヌ)	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)	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)	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))	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))	6.93%	

「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」

リスク抑制のため実施した資産売却に伴うオン・バランス資産の減少を主因に比率が改善したものと

連結レバレッジ比率の構成に関する開示事項(2023年3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	2023年 3月末	2022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		73,462,350
1a	1	連結貸借対照表における総資産の額		78,805,283
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(△)		5,342,932
2	7	Tier1 資本に係る調整項目の額(△)		215,659
3		オン・バランス資産の額 (イ)		73,246,691
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		803,283
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		528,150
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		-
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(△)		23
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(△)		
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)		1,331,410
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		3,951,154
13		レポ取引等に関する資産の額から控除した額(△)		3,796,056
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		1,138,995
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)		1,294,093
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		6,794,697
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(△)		2,027,828
19	6	オフ・バランス取引に関する額 (ニ)		4,766,869
連結レバレッジ比率 (5)				
20		資本の額 (ホ)		6,339,024
21	8	総エクスポージャーの額((イ)+(ロ)+(ハ)+(ニ)) (ヘ)		80,639,064
22		連結レバレッジ比率((ホ)/(ヘ))		7.86%
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)		80,639,064
		日本銀行に対する預け金の額		20,529,737
		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')		101,168,802
		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'))		6.26%