

連結レバレッジ比率の構成に関する開示事項(2023年9月末)

(単位:百万円)

項番(国際 様式(LR1)の 該当番号)	項目	2023年9月末	2023年6月末
1	連結貸借対照表における総資産の額	101,953,904	105,344,905
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(△)	20,567,629	20,176,384
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	557,847	527,611
8a	デリバティブ取引等に関する額	953,376	726,830
8b	デリバティブ取引等に関連する資産の額(△)	395,529	199,219
9	レポ取引等に関する調整額	1,137,076	875,837
9a	レポ取引等に関する額	2,037,545	1,095,282
9b	レポ取引等に関する額(△)	900,468	219,445
10	オフ・バランス取引に関する額	4,360,891	4,440,011
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	4,525,552	4,781,405
12a	Tier1 資本に係る調整項目の額(貸倒引当金以外)(△)	378,375	197,957
12b	支払承諾見返勘定の額(△)	3,289,955	3,286,734
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(△)	857,221	1,296,714
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	82,916,538	86,220,357

連結レバレッジ比率の構成に関する開示事項(2023年9月末)

(単位:百万円、%)

項番(国際様式(LR2)の該当番号)	項目	2023年9月末	2023年6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	76,800,321	81,463,123
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(△)	857,221	1,296,714
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)(△)	-	10,218
6	Tier1 資本に係る調整項目の額(貸倒引当金以外)(△)	378,375	197,957
7	オン・バランス資産の額 (イ)	75,564,724	79,958,232
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	409,041	220,683
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	544,335	506,147
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)	953,376	726,830
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	4,895,205	3,646,334
15	レボ取引等に関する資産の額から控除した額(△)	3,994,737	3,426,889
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	1,137,076	875,837
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)	2,037,545	1,095,282
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	6,486,398	6,536,287
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(△)	2,125,506	2,096,275
22	オフ・バランス取引に関する額 (ニ)	4,360,891	4,440,011
連結レバレッジ比率 (5)			
23	資本の額 (ホ)	5,562,206	6,526,705
24	総エクスポージャーの額((イ)+(ロ)+(ハ)+(ニ)) (ヘ)	82,916,538	86,220,357
25	連結レバレッジ比率(ホ)÷(ヘ)	6.70%	7.56%
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	-	-
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)	82,916,538	86,220,357
	日本銀行に対する預け金の額	20,567,629	20,176,384
	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')	103,484,167	106,396,741
	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'))	5.37%	6.13%
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))	610,408	259,873
	レボ取引等に関する資産の額に係る平均値 (ト)	4,327,824	3,666,246
	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)	3,717,415	3,406,373
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))	900,468	219,445
14	レボ取引等に関する資産の額に係る四半期末の値 (リ)	4,895,205	3,646,334
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)	3,994,737	3,426,889
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)	82,626,477	86,260,786
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)	103,194,107	106,437,170
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))	6.73%	7.56%
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))	5.39%	6.13%

「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」

前四半期末対比でその他有価証券評価差額金が減少したことに伴い、資本の額が減少したことによるもの。