

連結レバレッジ比率の構成に関する開示事項(2024年3月末)

(単位:百万円)

| 項番(国際様式(LR1)の該当番号) | 項目 | 2024年3月末 | 2023年12月末 |
|--------------------|---|-------------|-------------|
| 1 | 連結貸借対照表における総資産の額 | 99,804,876 | 98,959,581 |
| 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(△) | 19,463,591 | 19,804,897 |
| 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 | 679,574 | 18,736 |
| 8a | デリバティブ取引等に関する額 | 857,251 | 870,283 |
| 8b | デリバティブ取引等に関連する資産の額(△) | 177,677 | 851,546 |
| 9 | レポ取引等に関する調整額 | 1,007,360 | 1,398,723 |
| 9a | レポ取引等に関する額 | 1,063,672 | 1,495,031 |
| 9b | レポ取引等に関する額(△) | 56,312 | 96,307 |
| 10 | オフ・バランス取引に関する額 | 4,257,232 | 4,417,644 |
| 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 | △ 4,478,813 | △ 3,491,184 |
| 12a | Tier1 資本に係る調整項目の額(貸倒引当金以外)(△) | 163,524 | 127,137 |
| 12b | 支払承諾見返勘定の額(△) | 3,258,947 | 3,328,877 |
| 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(相殺し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(△) | 1,056,341 | 35,169 |
| 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 | 81,806,638 | 81,498,603 |

連結レバレッジ比率の構成に関する開示事項(2024年3月末)

(単位:百万円、%)

| 項番(国際様式(LR2)の該当番号) | 項目 | 2024年3月末 | 2023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 | 76,848,347 | 74,877,951 |
| 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(△) | 1,056,341 | 35,169 |
| 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)(△) | 163,524 | 127,137 |
| 7 | オン・バランス資産の額 (イ) | 75,628,481 | 74,715,644 |
| 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 | 303,795 | 344,629 |
| 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 | 553,456 | 525,653 |
| 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) | 857,251 | 870,283 |
| 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 | 4,244,633 | 4,279,661 |
| 15 | レボ取引等に関する資産の額から控除した額(△) | 4,188,320 | 4,183,353 |
| 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 | 1,007,360 | 1,398,723 |
| 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) | 1,063,672 | 1,495,031 |
| 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 | 6,239,669 | 6,512,047 |
| 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(△) | 1,982,436 | 2,094,403 |
| 22 | オフ・バランス取引に関する額 (ニ) | 4,257,232 | 4,417,644 |
| 連結レバレッジ比率 (5) | | | |
| 23 | 資本の額 (ホ) | 5,607,290 | 6,516,274 |
| 24 | 総エクスポージャーの額((イ)+(ロ)+(ハ)+(ニ)) (ヘ) | 81,806,638 | 81,498,603 |
| 25 | 連結レバレッジ比率((ホ)/(ヘ)) | 6.85% | 7.99% |
| 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) | 81,806,638 | 81,498,603 |
| | 日本銀行に対する預け金の額 | 19,463,591 | 19,804,897 |
| | 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') | 101,270,230 | 101,303,500 |
| | 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')) | 5.53% | 6.43% |
| 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)) | 102,199 | 458,308 |
| | レボ取引等に関する資産の額に係る平均値 (ト) | 4,339,452 | 4,699,707 |
| | 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) | 4,237,253 | 4,241,398 |
| 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)) | 56,312 | 96,307 |
| 14 | レボ取引等に関する資産の額に係る四半期末の値 (リ) | 4,244,633 | 4,279,661 |
| 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) | 4,188,320 | 4,183,353 |
| 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) | 81,852,525 | 81,860,603 |
| 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) | 101,316,117 | 101,665,501 |
| 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)) | 6.85% | 7.96% |
| 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)) | 5.53% | 6.40% |

「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。