

## 単体レバレッジ比率の構成に関する開示事項(2020年6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 6月末	2020年 3月末
<b>オン・バランス資産の額 (1)</b>				
1		調整項目控除前のオン・バランス資産の額	86,307,891	102,811,658
1a	1	貸借対照表における総資産の額	87,649,623	103,403,535
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)	1,341,732	591,876
2	7	Tier1 資本に係る調整項目の額(Δ)	149,635	141,703
3		オン・バランス資産の額 (イ)	86,158,255	102,669,955
<b>デリバティブ取引等に関する額 (2)</b>				
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	22,297	204,159
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	437,667	461,915
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)	115,486	137,908
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)	344,479	528,165
<b>レボ取引等に関する額 (3)</b>				
12		レボ取引等に関する資産の額	974,525	17,779
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	486,633	651,178
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)	1,461,158	668,957
<b>オフ・バランス取引に関する額 (4)</b>				
17		オフ・バランス取引の想定元本の額	3,059,606	2,634,449
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)	1,922,908	1,620,906
19	6	オフ・バランス取引に関する額 (ニ)	1,136,697	1,013,543
<b>単体レバレッジ比率 (5)</b>				
20		資本の額 (ホ)	9,292,871	8,558,622
21	8	総エクスポージャーの額((イ)+(ロ)+(ハ)+(ニ)) (ヘ)	89,100,591	104,880,621
22		単体レバレッジ比率((ホ)/(ヘ))	10.42%	8.16%
<b>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)</b>				
		総エクスポージャーの額 (ヘ)	89,100,591	
		日本銀行に対する預け金の額	19,972,990	
		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')	109,073,582	
		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'))	8.51%	

## 「前四半期末の単体レバレッジ比率との間に著しい差異を生じた原因」

2019年(平成31年)金融庁・農林水産省告示第4号(以下、告示)において、2020年(令和2年)6月30日付告示改正に伴い、日本銀行に対する預け金の額が総エクスポージャーの額より除外されたことによるもの。