グローバルなシステム上重要な銀行の選定指標に関する事項

■グローバルなシステム上重要な銀行の選定指標に関する開示事項

(単位：百万円)

GSIB1：G-SIB選定指標				
国際様式の該当番号			2020年3月末	2019年3月末
1	国際的な活動	対外与信の残高	59,438,067	52,187,827
2		対外債務の残高	42,419,213	35,256,002
3	規模	資産及び取引に関する残高の合計額	238,863,106	220,856,829
4	相互連関性	金融機関等向け与信に関する残高の合計額	35,825,017	32,216,204
5		金融機関等に対する債務に関する残高の合計額	23,122,877	18,722,769
6		発行済の有価証券の残高	24,806,153	28,193,246
7	代替可能性/金融インフラ	信託財産及びこれに類する資産の残高	10,935,708	11,466,654
8		決済システムを通じた決済の年間の合計額	4,150,572,853	3,431,377,752
9		債券及び株式に係る引受けの年間の合計額	9,959,297	9,149,209
10	複雑性	金融商品市場等によらないで行う金融機関等との派生商品取引及び長期決済期間取引に係る想定元本額の合計額	901,817,377	778,148,994
11		観察可能な市場データ以外の情報に基づき公正価値評価された資産の残高	1,029,342	1,003,465
12		売買目的有価証券及びその他有価証券の残高の合計額	10,625,227	10,131,349

(注)この面において使用する用語は、特段の定めがない限り、自己資本比率告示及び持株自己資本比率告示において使用する用語の例によるものとする。

a　国際様式の該当番号（以下この面において「項番」という。）３「規模　資産及び取引に関する残高の合計額」の項には、次に掲げる額の合計額を記載すること。

(1) オン・バランス資産の額（貸借対照表又は連結貸借対照表の総資産の額から支払承諾見返勘定の額並びに(2)及び(3)に掲げる事項に関して貸借対照表又は連結貸借対照表に計上されている額を控除した額をいう。）

(2)　デリバティブ取引等（先渡、スワップ、オプションその他の派生商品取引及び長期決済期間取引をいう。以下(2)及び(4)において同じ。）に関する額（デリバティブ取引等について算出したエクスポージャーの額（デリバティブ取引等についてカレント・エクスポージャー方式で計算した再構築コストの額（当該額が零を下回る場合にあっては、零とする。）及びアドオンの額並びにプロテクションを提供するクレジット・デリバティブに係る想定元本の額の合計額をいう。）及びデリバティブ取引等に関連して現金で差し入れた証拠金の対価の額の合計額をいう。）

(3)レポ形式の取引に関する額（レポ形式の取引における現金の受取債権の額及びレポ形式の取引の単位ごとに算出した取引の相手方に対するエクスポージャーの額（当該額が零を下回る場合にあっては、零とする。）の合計額をいう。）

(4)オフ・バランス取引（デリバティブ取引等及びレポ形式の取引を除く。）に関する額（取引の相手方に対する信用リスクに係るエクスポージャーの額、対象資産に係るエクスポージャーの額及び証券化エクスポージャーの額の合計額をいう。）

b 項番４「相互連関性　金融機関等向け与信に関する残高の合計額」の項には、金融機関等（金融商品取引法第二条第九項に規定する金融商品取引業者、保険会社、中央清算機関、年金基金その他これらに類する事業を営む者を含む。以下b及びcにおいて同じ。）向け与信に関する次に掲げる事項の残高の合計額を記載すること。

(1)金融機関等向け預金及び貸出金の額（コミットメントの未引出額を含む。）

(2)金融機関等が発行した有価証券（担保付社債、一般無担保社債、劣後債、短期社債、譲渡性預金及び株式をいう。項番６において同じ。）の保有額

(3)金融機関等とのレポ形式の取引のカレント・エクスポージャーの額（法的に有効な相対ネッティング契約の効果を勘案することができるものとし、零を下回らないものに限る。）

(4)金融商品取引法第二条第十四項に規定する金融商品市場及び同条第八項第三号ロに規定する外国金融商品市場（項番10及びcにおいて「金融商品市場等」という。）によらないで行う金融機関等との派生商品取引及び長期決済期間取引に係る公正価値評価額及びカレント・エクスポージャー方式で計算したアドオンの額（法的に有効な相対ネッティング契約の効果を勘案することができるものとし、零を下回らないものに限る。）

c 項番５「相互連関性　金融機関等に対する債務に関する残高の合計額」の項には、次に掲げる事項の残高の合計額を記載すること。

(1)金融機関等からの預金及び借入金の額（コミットメントの未引出額を含む。）

(2)金融機関等とのレポ形式の取引のカレント・エクスポージャーの額（法的に有効な相対ネッティング契約の効果を勘案することができるものとし、零を上回らないものに限る。）

(3)金融商品市場等によらないで行う金融機関等との派生商品取引及び長期決済期間取引に係る公正価値評価額及びカレント・エクスポージャー方式で計算したアドオンの額（法的に有効な相対ネッティング契約の効果を勘案することができるものとし、零を上回らないものに限る。）

d 項番８「代替可能性/金融インフラ　決済システムを通じた決済の年間の合計額」の項には、直近に終了した事業年度における日本銀行金融ネットワークシステム、全国銀行資金決済ネットワークその他これらに類する決済システムを通じた決済の年間の合計額を記載すること。

e 項番９「代替可能性/金融インフラ　債券及び株式に係る引受けの年間の合計額」の項には、直近に終了した事業年度における債券及び株式に係る引受け（金融商品取引法第二条第八項第六号に規定する有価証券の引受けをいう。）の年間の合計額を記載すること。
f 項番10「複雑性　金融商品市場等によらないで行う金融機関等との派生商品取引及び長期決済期間取引に係る想定元本額の合計額」における金融機関等とは、bに規定する金融機関等をいう。
g 項番12「複雑性　売買目的有価証券及びその他有価証券の残高の合計額」の項には、売買目的有価証券及びその他有価証券（いずれも流動性が高いと認められるものを除く。）の残高の合計額を記載すること。
h この面に定める各項目につき、自金融機関で該当する額がない場合には項を削除せず、「－」を記載すること。
i この面に記載する額は、この面で指定された単位で記載し、当該単位未満の端数は切り捨てること。
j この面は、国際統一基準行（銀行の連結子法人等である銀行若しくは銀行持株会社の連結子法人等である銀行（銀行の連結子法人等である銀行を除く。）又は規制外国法人の連結子法人等を除く。）又は国際統一基準持株会社のうち、項番３の額を直近に終了した事業年度末の為替レートでユーロに換算して得られたものが二千億ユーロを超えるもの及びこれに準ずる国際統一基準行又は国際統一基準持株会社として金融庁長官が指定するものに限り、作成するものとする。

■持株レバレッジ比率の構成に関する事項

(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	2019年3月末	2020年3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	179,349,049	189,089,655
1a	1	連結貸借対照表における総資産の額	203,659,146	219,863,518
1b	2	持株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	持株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(△)	24,310,096	30,773,863
2	7	Tier1資本に係る調整項目の額(△)	999,843	878,104
3		オン・バランス資産の額 (イ)	178,349,206	188,211,550
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		
		デリバティブ取引等に関する再構築コストの額	2,702,937	6,878,993
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		
		デリバティブ取引等に関するアドオンの額	4,302,269	4,556,886
		デリバティブ取引等に関連して現金で差し入れた証拠金の対価の額	622,875	923,702
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		
		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現金で差し入れた証拠金の対価の額	—	—
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(△)	97,391	151,482
8		清算会員である銀行又は銀行持株会社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	591,253	900,439
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(△)	541,447	744,710
11	4	デリバティブ取引等に関する額 (ロ)	7,580,496	12,363,828
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	10,526,838	13,758,920
13		レポ取引等に関する資産の額から控除した額(△)	—	—
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	731,057	459,828
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)	11,257,895	14,218,749
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	61,366,247	61,636,792
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(△)	39,015,093	38,942,263
19	6	オフ・バランス取引に関する額 (ニ)	22,351,153	22,694,529
持株レバレッジ比率(5)				
20		資本の額 (ホ)	10,727,228	10,249,936
21	8	総エクスポージャーの額 ((イ)+(ロ)+(ハ)+(ニ)) (ヘ)	219,538,751	237,488,658
22		持株レバレッジ比率 ((ホ)/(ヘ))	4.88%	4.31%

前期の持株レバレッジ比率との間に著しい差異を生じた原因

持株レバレッジ比率の低下は、その他Tier1資本に含まれる資本調達手段の減少やその他有価証券評価差額金の減少等に伴う資本の額の減少に加え、現金預け金や貸出金を中心としたオン・バランス資産の増加により、総エクスポージャーの額が増加したことによるもの。