

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			2021年3月末	2020年3月末
1	国際的な活動	対外与信の残高	61,121,865	59,438,067
2		対外債務の残高	43,735,669	42,419,213
3	規模	資産及び取引に関する残高の合計額	261,628,332	238,863,106
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	37,084,619	35,825,017
5		金融機関等に対する債務に関する残高の合計額	21,420,138	23,122,877
6		発行済の有価証券の残高	29,390,832	24,806,153
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	12,031,686	10,935,708
8		決済システムを通じた決済の年間の合計額	4,233,462,531	4,150,572,853
9		債券及び株式に係る引受けの年間の合計額	11,773,041	9,959,297
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	903,061,478	901,817,377
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	507,291	1,029,342
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	12,514,926	10,625,227

(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トリ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トリ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トリ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トリ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	2020年3月末	2021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	189,089,655	152,849,023
1a	1	連結貸借対照表における総資産の額	219,863,518	180,700,101
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(△)	30,773,863	27,851,078
2	7	Tier1資本に係る調整項目の額(△)	878,104	1,073,527
3		オン・バランス資産の額 (イ)	188,211,550	151,775,496
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	6,878,993	2,652,012
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	4,556,886	4,033,004
		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	923,702	833,230
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(△)	151,482	145,293
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	900,439	1,153,370
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(△)	744,710	970,631
11	4	デリバティブ取引等に関する額 (ロ)	12,363,828	7,555,693
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	13,758,920	11,392,567
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	459,828	1,008,468
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)	14,218,749	12,401,035
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	61,636,792	69,657,013
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(△)	38,942,263	43,218,454
19	6	オフ・バランス取引に関する額 (ニ)	22,694,529	26,438,558
持株レバレッジ比率(5)				
20		資本の額 (ホ)	10,249,936	11,199,300
21	8	総エクスポージャーの額 ((イ)+(ロ)+(ハ)+(ニ)) (ヘ)	237,488,658	198,170,783
22		持株レバレッジ比率 ((ホ)/(ヘ))	4.31%	5.65%
日本銀行に対する預け金を算入する場合の持株レバレッジ比率(6)				
		総エクスポージャーの額 (ヘ)		198,170,783
		日本銀行に対する預け金の額		61,884,206
		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´)		260,054,990
		日本銀行に対する預け金を算入する場合の持株レバレッジ比率 ((ホ)/(ヘ´))		4.30%

(注) 2020年3月末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上昇は、平成31年金融庁告示第12号(以下、告示)において、2020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。