

## 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			2023年3月末
1	国際的な活動	対外与信の残高	86,194,529
2		対外債務の残高	73,695,197
3	規模	資産及び取引に関する残高の合計額	291,673,049
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	51,152,083
5		金融機関等に対する債務に関する残高の合計額	25,471,036
6		発行済の有価証券の残高	33,447,629
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	16,110,817
8		決済システムを通じた決済の年間の合計額	5,454,562,907
9		債券及び株式に係る引受けの年間の合計額	5,084,242
10		トレーディング量の合計額	102,325,402
11	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	1,603,772,144
12		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	506,004
13		売買目的有価証券及びその他有価証券の残高の合計額	12,007,752

(単位：百万円)

GSIB1：G-SIB選定指標			
国際様式の該当番号			2024年3月末
1	国際的な活動	対外与信の残高	100,058,511
2		対外債務の残高	74,639,376
3	規模	資産及び取引に関する残高の合計額	316,522,252
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	55,073,343
5		金融機関等に対する債務に関する残高の合計額	24,377,143
6		発行済の有価証券の残高	43,000,776
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	19,668,879
8		決済システムを通じた決済の年間の合計額	5,433,594,969
9		債券及び株式に係る引受けの年間の合計額	10,018,848
10a		債券に係るトレーディング量の合計額	89,370,953
10b		株式その他有価証券に係るトレーディング量の合計額	83,080,646
11	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	1,661,132,343
12		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	452,714
13		売買目的有価証券及びその他有価証券の残高の合計額	16,384,385

■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	2023年3月末	2024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	175,221,153	
1a	1	連結貸借対照表における総資産の額	210,008,235	
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(△)	34,787,082	
2	7	Tier1資本に係る調整項目の額(△)	1,735,746	
3		オン・バランス資産の額 (イ)	173,485,406	
<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		
		デリバティブ取引等に関する再構築コストの額	4,790,390	
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	5,435,663	
		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	981,452	
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(△)	145,156	
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	1,330,211	
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(△)	1,168,020	
11	4	デリバティブ取引等に関する額 (ロ)	11,224,540	
<b>レポ取引等に関する額(3)</b>				
12		レポ取引等に関する資産の額	11,362,558	
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	453,886	
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)	11,816,444	
<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	81,463,037	
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(△)	48,472,455	
19	6	オフ・バランス取引に関する額 (ニ)	32,990,581	
<b>持株レバレッジ比率(5)</b>				
20		資本の額 (ホ)	11,548,912	
21	8	総エクスポージャーの額 ((イ)+(ロ)+(ハ)+(ニ)) (ヘ)	229,516,974	
22		持株レバレッジ比率 ((ホ)/(ヘ))	5.03%	
		適用する所要持株レバレッジ比率	3.00%	
		適用する所要持株レバレッジ・バッファ比率	0.50%	
<b>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)</b>				
		総エクスポージャーの額 (ヘ)	229,516,974	
		日本銀行に対する預け金の額	60,420,329	
		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´)	289,937,303	
		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´))	3.98%	

(単位：百万円)

項番(国際様式(LR1)の該当番号)	項目	2023年3月末	2024年3月末
1	連結貸借対照表における総資産の額		295,236,701
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(△)		—
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(△)		61,284,825
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		1,076,148
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		749,438
8a	デリバティブ取引等に関する額		11,991,542
8b	デリバティブ取引等に関連する資産の額(△)		11,242,104
9	レポ取引等に関する調整額		637,513
9a	レポ取引等に関する額		15,962,743
9b	レポ取引等に関する額(△)		15,325,230
10	オフ・バランス取引に関する額		34,416,562
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		△18,317,462
12a	Tier1資本に係る調整項目の額(貸倒引当金以外)(△)		2,723,350
12b	支払承諾見返勘定の額(△)		14,869,558
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(△)		724,554
12e	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。)		—
13	総エクスポージャーの額		252,514,076

(単位：百万円、%)

項番(国際様式(LR2)の該当番号)	項目	2023年3月末	2024年3月末
<b>オン・バランス資産の額(1)</b>			
1	個別項目調整前のオン・バランス資産の額		193,591,132
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(△)		724,554
4	レポ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)(△)		2,723,350
7	オン・バランス資産の額 (イ)		190,143,228
<b>デリバティブ取引等に関する額(2)</b>			
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		5,306,692
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		6,417,609
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		1,445,342
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(△)		1,178,102
13	デリバティブ取引等に関する額 (ロ)		11,991,542
<b>レポ取引等に関する額(3)</b>			
14	レポ取引等に関する資産の額		15,325,230
15	レポ取引等に関する資産の額から控除した額(△)		—
16	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		637,513
17	代理取引のエクスポージャーの額		—
18	レポ取引等に関する額 (ハ)		15,962,743
<b>オフ・バランス取引に関する額(4)</b>			
19	オフ・バランス取引の想定元本の額		92,108,666
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(△)		57,692,103
22	オフ・バランス取引に関する額 (ニ)		34,416,562
<b>持株レバレッジ比率(5)</b>			
23	資本の額 (ホ)		13,311,550
24	総エクスポージャーの額((イ)+(ロ)+(ハ)+(ニ)) (ヘ)		252,514,076
25	持株レバレッジ比率((ホ)/(ヘ))		5.27%
26	適用する所要持株レバレッジ比率		3.00%
27	適用する所要持株レバレッジ・バッファ比率		0.50%
<b>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)</b>			
	総エクスポージャーの額 (ヘ)		252,514,076
	日本銀行に対する預け金の額		61,284,825
	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´)		313,798,901
	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´))		4.24%
<b>平均値の開示(7)</b>			
28	レポ取引等に関する資産の額(控除後)に係る平均値((ト)+(チ))		12,891,568
	レポ取引等に関する資産の額に係る平均値 (ト)		12,891,568
	レポ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)		—
29	レポ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))		15,325,230
14	レポ取引等に関する資産の額に係る四半期末の値 (リ)		15,325,230
15	レポ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)		—
30	総エクスポージャーの額(レポ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)		250,080,415
30a	総エクスポージャーの額(レポ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)		311,365,240
31	持株レバレッジ比率(レポ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))		5.32%
31a	持株レバレッジ比率(レポ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))		4.27%