

2023年8月4日

株式会社山ロフィナンシャルグループ（連結）

## 持株レバレッジ比率の構成に関する事項（2023年6月期）

直前の四半期との比較

（平成26年金融庁告示第7号、別紙様式第六号）

（単位：百万円、％）

項番（国際様式（LRI）の該当番号）	項目	当四半期末	前四半期末
1	連結貸借対照表における総資産の額	12,420,443	12,211,645
2	連結レバレッジ比率の範囲又は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（△）	1,670,306	1,752,726
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・フロー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	1,676	17,819
8a	デリバティブ取引等に関する額	62,304	74,384
8b	デリバティブ取引等に関連する資産の額（△）	60,628	56,564
9	レポ取引等に関する調整額	4,818	5,233
9a	レポ取引等に関する額	4,818	5,233
9b	レポ取引等に関する額（△）	-	-
10	オフ・バランス取引に関する額	250,536	226,134
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	△ 165,363	△ 111,767
12a	Tier1資本に係る調整項目の額（貸倒引当金以外）（△）	28,777	28,827
12b	支払承諾見返勘定の額（△）	86,961	58,967
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（△）	49,625	23,972
12e	連結レバレッジ比率の範囲又は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	10,841,804	10,596,339

項番 (国際様式 (LR2) の該当番号)	項目	当四半期末	前四半期末
<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	10,602,547	10,343,386
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 (△)	49,625	23,972
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) (△)	28,777	28,827
7	オン・バランス資産の額 (イ)	10,524,144	10,290,586
<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	19,313	29,071
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	42,991	45,312
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等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)	62,304	74,384
<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	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	4,818	5,233
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)	4,818	5,233
<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	749,842	740,161
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 (△)	499,306	514,026
22	オフ・バランス取引に関する額 (ニ)	250,536	226,134
<b>連結レバレッジ比率又は持株レバレッジ比率 (5)</b>			
23	資本の額 (ホ)	596,460	576,107
24	総エクスポージャーの額 ((イ) + (ロ) + (ハ) + (ニ)) (ヘ)	10,841,804	10,596,339
25	連結レバレッジ比率又は持株レバレッジ比率 ((ホ) / (ヘ))	5.50	5.43
26	適用する所要連結レバレッジ比率又は所要持株レバレッジ比率	3.15	3.15
27	適用する所要連結レバレッジ・バッファ率又は所要持株レバレッジ・バッファ率	0.00	0.00
<b>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又は持株レバレッジ比率 (6)</b>			
	総エクスポージャーの額 (ヘ)	10,841,804	10,596,339
	日本銀行に対する預け金の額	1,670,306	1,752,726
	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')	12,512,110	12,349,066
	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又は持株レバレッジ比率 ((ホ) / (ヘ'))	4.76	4.66
<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))	-	-
	レポ取引等に関する資産の額に係る平均値 (ト)	-	-
	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))	-	-
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	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)	10,841,804	10,596,339
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)	12,512,110	12,349,066
31	連結レバレッジ比率又は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))	5.50	5.43
31a	連結レバレッジ比率又は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))	4.76	4.66