

連結レバレッジ比率の構成に関する開示（三菱UFJ銀行）

（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	2019年12月末
オン・バランス資産の額				
1		調整項目控除前のオン・バランス資産の額	239,209,492	228,359,274
1a	1	連結貸借対照表における総資産の額	270,418,512	251,661,178
1b	2	連結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（△）	-	30,031
1c	7	連結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（△）	31,209,020	23,271,872
2	7	Tier1 資本に係る調整項目の額（△）	993,364	1,200,337
3		オン・バランス資産の額（イ）	238,216,128	227,158,936
デリバティブ取引等に関する額				
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	2,943,417	1,894,914
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	4,037,344	3,866,330
		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	2,103,793	1,708,909
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	47,889	38,074
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（△）	-	-
8		清算会員である銀行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	221,622	227,946
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（△）	69,651	70,118
11	4	デリバティブ取引等に関する額（ロ）	9,284,417	7,666,056
レポ取引等に関する額				
12		レポ取引等に関する資産の額	14,313,069	8,784,756
13		レポ取引等に関する資産の額から控除した額（△）	606,937	846,988
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	373,266	533,595
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）	14,079,397	8,471,363
オフ・バランス取引に関する額				
17		オフ・バランス取引の想定元本の額	71,463,839	73,817,673
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（△）	44,504,816	45,475,161
19	6	オフ・バランス取引に関する額（ニ）	26,959,022	28,342,511
連結レバレッジ比率				
20		資本の額（ホ）	12,170,005	12,994,717
21	8	総エクスポージャーの額（（イ）+（ロ）+（ハ）+（ニ））（ヘ）	288,538,965	271,638,868
22		連結レバレッジ比率（（ホ）/（ヘ））	4.21%	4.78%

※企業会計基準第30号「時価の算定に関する会計基準」及び企業会計基準適用指針第31号「時価の算定に関する会計基準の適用指針」の遡及適用により、2019年度期首以降の利益剰余金が増減となりますが、2019年12月末の計数に当該変更は反映していません。

前四半期の連結レバレッジ比率との間に著しい差異を生じた原因

連結レバレッジ比率の低下は、利益剰余金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、現金預け金や有価証券を中心としたオン・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。