

持株レバレッジ比率の構成に関する開示（三菱UFJフィナンシャル・グループ）

（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6月末	2020年3月末
<b>オン・バランス資産の額</b>				
1		調整項目控除前のオン・バランス資産の額	221,462,546	282,696,677
1a	1	連結貸借対照表における総資産の額	265,120,766	336,571,379
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（△）	43,658,220	53,874,701
2	7	Tier1 資本に係る調整項目の額（△）	1,992,875	2,016,649
3		オン・バランス資産の額（イ）	219,469,671	280,680,028
<b>デリバティブ取引等に関する額</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	5,278,763	5,113,721
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	5,887,917	5,966,020
		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	2,280,840	2,202,258
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	76,534	51,192
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（△）	717,879	696,484
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	4,556,676	3,931,072
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（△）	3,839,162	3,320,633
11	4	デリバティブ取引等に関する額（ロ）	13,523,689	13,247,147
<b>レポ取引等に関する額</b>				
12		レポ取引等に関する資産の額	20,034,826	29,651,385
13		レポ取引等に関する資産の額から控除した額（△）	2,115,811	1,887,952
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	2,493,591	2,138,169
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）	20,412,606	29,901,602
<b>オフ・バランス取引に関する額</b>				
17		オフ・バランス取引の想定元本の額	96,237,119	92,769,789
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（△）	65,905,199	63,481,008
19	6	オフ・バランス取引に関する額（ニ）	30,331,920	29,288,781
<b>持株レバレッジ比率</b>				
20		資本の額（ホ）	15,863,373	15,623,321
21	8	総エクスポージャーの額（（イ）+（ロ）+（ハ）+（ニ））（ヘ）	283,737,887	353,117,559
22		持株レバレッジ比率（（ホ）/（ヘ））	5.59%	4.42%

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			
		総エクスポージャーの額 (へ)	283,737,887
		日本銀行に対する預け金の額	76,784,155
		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 (へ')	360,522,042
		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) / (へ'))	4.40%

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、2019年(平成31年)金融庁告示第12号(以下、告示)において、2020年(令和2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