

単体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6月末	2020年3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	162,841,462	213,959,247
	1a	1 貸借対照表における総資産の額	180,125,474	239,727,890
	1b	3 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（△）	17,284,012	25,768,642
2	7	Tier1 資本に係る調整項目の額（△）	581,574	580,437
3		オン・バランス資産の額（イ）	162,259,887	213,378,809
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	2,266,650	2,706,621
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	3,627,256	3,767,250
		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	1,849,463	2,040,586
6		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	-	-
		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	40,282	28,326
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	376,442	221,622
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（△）	68,953	69,651
11	4	デリバティブ取引等に関する額（ロ）	8,091,141	8,694,756
レポ取引等に関する額				
12		レポ取引等に関する資産の額	3,170,253	9,890,347
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	995,946	373,266
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）	4,166,199	10,263,613
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	62,081,059	57,876,128
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（△）	38,275,117	35,382,391
19	6	オフ・バランス取引に関する額（ニ）	23,805,942	22,493,737
単体レバレッジ比率				
20		資本の額（ホ）	10,541,119	10,254,608
21	8	総エクスポージャーの額（(イ) + (ロ) + (ハ) + (ニ)）（ヘ）	198,323,170	254,830,917
22		単体レバレッジ比率（(ホ) / (ヘ)）	5.31%	4.02%

日本銀行に対する預け金を算入する場合の単体レバレッジ比率			
		総エクスポージャーの額 (へ)	198,323,170
		日本銀行に対する預け金の額	65,161,209
		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)	263,484,379
		日本銀行に対する預け金を算入する場合の単体レバレッジ比率 ((ホ) / (へ))	4.00%

2020年3月末の単体レバレッジ比率との間に著しい差異を生じた原因

単体レバレッジ比率の上昇は、2019年(平成31年)金融庁告示第11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