

連結レバレッジ比率の構成に関する開示（三菱UFJ信託銀行）

（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	2022年12月末	2022年9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	20,708,503	23,217,198
1a	1	連結貸借対照表における総資産の額	22,699,642	25,858,991
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（△）	-	-
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（△）	1,991,139	2,641,793
2	7	Tier1 資本に係る調整項目の額（△）	724,011	723,967
3		オン・バランス資産の額（イ）	19,984,491	22,493,231
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	732,530	691,256
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	379,418	356,415
		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	497,730	1,017,063
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（△）	151	113
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	-	-
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（△）	-	-
11	4	デリバティブ取引等に関する額（ロ）	1,609,527	2,064,621
レポ取引等に関する額				
12		レポ取引等に関する資産の額	458,749	576,651
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	137,140	163,387
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）	595,889	740,039
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	3,226,599	3,097,074
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（△）	1,578,514	1,469,788
19	6	オフ・バランス取引に関する額（ニ）	1,648,085	1,627,285
連結レバレッジ比率				
20		資本の額（ホ）	1,721,892	1,679,282
21	8	総エクスポージャーの額（（イ）+（ロ）+（ハ）+（ニ））（ヘ）	23,837,993	26,925,178
22		連結レバレッジ比率（（ホ）/（ヘ））	7.22%	6.23%

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				
		総エクスポージャーの額 (へ)	23,837,993	26,925,178
		日本銀行に対する預け金の額	14,610,563	13,266,282
		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')	38,448,556	40,191,460
		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 ((ホ) / (へ'))	4.47%	4.17%

2022年9月末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上昇は、主として有価証券や貸出金の残高減少によるオン・バランス資産を中心とした総エクスポージャーの減少によるもの。