

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	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	22,865,476	34,085,572
1a	1	連結貸借対照表における総資産の額	24,426,579	35,669,685
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（△）	1,561,103	1,584,112
2	7	Tier1 資本に係る調整項目の額（△）	553,937	580,470
3		オン・バランス資産の額（イ）	22,311,539	33,505,102
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	117,929	103,195
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	221,934	235,356
		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	80,817	128,295
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（△）	18	52,472
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）	420,663	414,375
レポ取引等に関する額				
12		レポ取引等に関する資産の額	1,067,800	942,423
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	134,324	153,020
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）	1,202,125	1,095,443
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	1,671,215	1,539,365
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（△）	623,103	558,856
19	6	オフ・バランス取引に関する額（ニ）	1,048,111	980,508
連結レバレッジ比率				
20		資本の額（ホ）	1,721,603	1,625,712
21	8	総エクスポージャーの額（（イ）+（ロ）+（ハ）+（ニ））（ヘ）	24,982,439	35,995,429
22		連結レバレッジ比率（（ホ）/（ヘ））	6.89%	4.51%

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)	24,982,439
		日本銀行に対する預け金の額	10,671,524
		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')	35,653,963
		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'))	4.82%

2020年3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、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