

単体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9月末	2020年6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	20,764,785	21,038,049
1a	1	貸借対照表における総資産の額	21,254,571	22,359,127
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（△）	489,786	1,321,077
2	7	Tier1 資本に係る調整項目の額（△）	328,363	327,804
3		オン・バランス資産の額（イ）	20,436,422	20,710,244
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	129,167	127,859
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	265,229	236,162
		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	72,087	79,137
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	-	-
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（△）	35	18
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）	466,448	443,140
レポ取引等に関する額				
12		レポ取引等に関する資産の額	169,510	1,009,000
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	138,782	157,445
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）	308,293	1,166,446
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	1,775,376	1,706,272
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（△）	787,467	762,246
19	6	オフ・バランス取引に関する額（ニ）	987,908	944,025
単体レバレッジ比率				
20		資本の額（ホ）	2,004,786	1,976,252
21	8	総エクスポージャーの額（（イ）+（ロ）+（ハ）+（ニ））（ヘ）	22,199,072	23,263,857
22		単体レバレッジ比率（（ホ）/（ヘ））	9.03%	8.49%

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)	22,199,072	23,263,857
		日本銀行に対する預け金の額	9,528,528	8,169,251
		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')	31,727,601	31,433,108
		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'))	6.31%	6.28%

2020年6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、主としてレポ取引等に関する額の減少に伴う総エクスポージャーの額の減少によるもの。