

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、％）

項番(国際様式(LR1)の該当番号)	項目	2024年3月末	2023年12月末
1	貸借対照表における総資産の額	35,652,492	
3	リスク移転の認識に係る要件を充足しない証券化エクスポージャーに係る調整	-	
4	中央銀行預け金に係る除外による調整(Δ)	10,547,698	
5	顧客資産のうち、貸借対照表に計上されている金額(Δ)		
6	有価証券の売買を約定日基準により会計処理している場合における調整項目	-	
7	キャッシュ・プーリング契約に基づく資金の移動に係る調整項目	-	
8	デリバティブ取引等に関する調整額	801,554	
8a	デリバティブ取引等に関する額	1,497,856	
8b	デリバティブ取引等に関連する資産の額(Δ)	696,301	
9	レポ取引等に関する調整額	304,350	
9a	レポ取引等に関する額	598,124	
9b	レポ取引等に関する額(Δ)	293,774	
10	オフ・バランス取引に関する額	2,380,907	
11	Tier1資本に係る調整項目の額(貸倒引当金)(Δ)	8,103	
12	その他の調整項目	Δ 1,206,171	
12a	Tier1資本に係る調整項目の額(貸倒引当金以外)(Δ)	405,044	
12b	支払承諾見返勘定の額(Δ)	39,201	
12c	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(相殺した額に相当する部分に限る。)	-	
12d	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(Δ)	761,925	
13	総エクスポージャーの額	27,377,331	

項番(国際様式(LR2)の該当番号)	項目	2024年3月末	2023年12月末
オン・バランス資産の額 (1)			
1	個別項目調整前のオン・バランス資産の額	24,075,516	
2	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(相殺した額に相当する部分に限る。)	-	
3	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(Δ)	761,925	
4	レポ取引等により受領した証券の計上額(Δ)	-	
5	Tier1資本に係る調整項目の額(貸倒引当金)(Δ)	8,103	
6	Tier1資本に係る調整項目の額(貸倒引当金以外)(Δ)	405,044	
7	オン・バランス資産の額 (イ)	22,900,443	
デリバティブ取引等に関する額 (2)			
8	デリバティブ取引等に関するRCの額に1.4を乗じた額	696,461	
9	デリバティブ取引等に関するPFEの額に1.4を乗じた額	801,394	
10	間接清算参加者に適格中央清算機関の債務履行を保証していない場合に零とした中央清算機関向けエクスポージャーの額(Δ)	-	
11	クレジット・デリバティブ等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	-	
12	クレジット・デリバティブ等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(Δ)	-	
13	デリバティブ取引等に関する額 (ロ)	1,497,856	
レポ取引等に関する額 (3)			
14	レポ取引等に関する資産の額	293,774	
15	レポ取引等に関する資産の額から控除した額(Δ)	-	
16	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	304,350	
17	代理取引のエクスポージャーの額	-	
18	レポ取引等に関する額 (ハ)	598,124	
オフ・バランス取引に関する額 (4)			
19	オフ・バランス取引の想定元本の額	3,151,439	
20	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(Δ)	770,531	
22	オフ・バランス取引に関する額 (ニ)	2,380,907	
単体レバレッジ比率 (5)			
23	資本の額 (ホ)	1,941,116	
24	総エクスポージャーの額((イ)+(ロ)+(ハ)+(ニ)) (ヘ)	27,377,331	
25	単体レバレッジ比率((ホ)/(ヘ))	7.09%	
26	適用する所要単体レバレッジ比率	3.00%	
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 (6)			
	総エクスポージャーの額 (ヘ)	27,377,331	
	日本銀行に対する預け金の額	10,547,698	
	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 (ヘ')	37,925,030	
	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)/(ヘ'))	5.11%	

平均値の開示 (7)			
28	レポ取引等に関する資産の額(控除後)に係る平均値((ト) + (チ))	846,018	
	レポ取引等に関する資産の額に係る平均値 (ト)	846,018	
	レポ取引等に関する資産の額から控除した額に係る平均値(Δ) (チ)	-	
29	レポ取引等に関する資産の額(控除後)に係る四半期末の値((リ) + (ヌ))	293,774	
14	レポ取引等に関する資産の額に係る四半期末の値 (リ)	293,774	
15	レポ取引等に関する資産の額から控除した額に係る四半期末の値(Δ) (ヌ)	-	
30	総エクスポージャーの額 (レポ取引等に関する資産の額(控除後)に係る平均値を使用し、日本銀行に対する預け金を算入しない場合) (ル)	27,929,576	
30a	総エクスポージャーの額 (レポ取引等に関する資産の額(控除後)に係る平均値を使用し、日本銀行に対する預け金を算入する場合) (ヲ)	38,477,275	
31	単体レバレッジ比率 (レポ取引等に関する資産の額(控除後)に係る平均値を使用し、日本銀行に対する預け金を算入しない場合)((ホ) / (ル))	6.95%	
31a	単体レバレッジ比率 (レポ取引等に関する資産の額(控除後)に係る平均値を使用し、日本銀行に対する預け金を算入する場合)((ホ) / (ヲ))	5.04%	

2023年12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、主としてその他有価証券評価差額金の増加による資本の増加によるもの。

(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	2024年3月末	2023年12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		23,234,199
1a	1	貸借対照表における総資産の額		26,433,047
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 (△)		3,198,848
2	7	Tier1 資本に係る調整項目の額 (△)		406,691
3		オン・バランス資産の額 (イ)		22,827,507
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		460,506
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		471,665
		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		482,507
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 (△)		537
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)		1,414,140
レポ取引等に関する額				
12		レポ取引等に関する資産の額		1,816,757
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		185,926
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)		2,002,684
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		3,319,316
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 (△)		1,403,273
19	6	オフ・バランス取引に関する額 (ニ)		1,916,042
単体レバレッジ比率				
20		資本の額 (ホ)		1,855,019
21	8	総エクスポージャーの額 ((イ) + (ロ) + (ハ) + (ニ)) (ヘ)		28,160,374
22		単体レバレッジ比率 ((ホ) / (ヘ))		6.58%
		適用する所要単体レバレッジ比率		3.00%

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)	28,160,374
		日本銀行に対する預け金の額	10,498,618
		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')	38,658,993
		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'))	4.79%