

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、％）

項番(国際 様式(LR1) の該当番 号)	項 目	2024年9月 末	2024年6月 末
1	連結貸借対照表における総資産の額	39,433,895	42,848,536
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(△)	-	-
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(△)	14,927,626	15,062,726
5	顧客資産のうち、連結貸借対照表に計上されている金額(△)		
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	325,984	462,962
8a	デリバティブ取引等に関する額	1,148,326	1,493,353
8b	デリバティブ取引等に関連する資産の額(△)	822,341	1,030,391
9	レポ取引等に関する調整額	216,238	148,417
9a	レポ取引等に関する額	784,460	885,053
9b	レポ取引等に関する額(△)	568,222	736,635
10	オフ・バランス取引に関する額	2,632,175	3,037,827
11	Tier1資本に係る調整項目の額(貸倒引当金)(△)	7,769	9,513
12	その他の調整項目	△ 1,485,806	△ 2,092,376
12a	Tier1資本に係る調整項目の額(貸倒引当金以外)(△)	1,181,101	1,147,160
12b	支払承諾見返勘定の額(△)	30,672	39,082
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(△)	274,032	906,133
12e	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。)	-	-
13	総エクスポージャーの額	26,187,091	29,333,126

項番(国際 様式(LR2) の該当番 号)	項 目	2024年9月末	2024年6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	23,085,032	25,979,699
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)	274,032	906,133
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)	7,769	9,513
6	Tier1資本に係る調整項目の額(貸倒引当金以外)(Δ)	1,181,101	1,147,160
7	オン・バランス資産の額 (イ)	21,622,129	23,916,891
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	399,481	715,891
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	748,844	777,462
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)	1,148,326	1,493,353
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	568,222	736,635
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	216,238	148,417
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)	784,460	885,053
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	3,606,241	4,089,950
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)	974,065	1,052,123
22	オフ・バランス取引に関する額 (ニ)	2,632,175	3,037,827
連結レバレッジ比率又は持株レバレッジ比率 (5)			
23	資本の額 (ホ)	1,675,443	1,646,457
24	総エクスポージャーの額((イ)+(ロ)+(ハ)+(ニ)) (ヘ)	26,187,091	29,333,126
25	連結レバレッジ比率((ホ)/(ヘ))	6.39%	5.61%
26	適用する所要連結レバレッジ比率	3.15%	3.15%
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 (6)			
	総エクスポージャーの額 (ヘ)	26,187,091	29,333,126
	日本銀行に対する預け金の額	14,927,626	15,062,726
	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´)	41,114,718	44,395,852
	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)/(ヘ´))	4.07%	3.70%

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))	628,941	708,409
	レポ取引等に関する資産の額に係る平均値 (ト)	628,941	708,409
	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))	568,222	736,635
14	レポ取引等に関する資産の額に係る四半期末の値 (リ)	568,222	736,635
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)	26,247,811	29,304,900
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)	41,175,437	44,367,626
31	連結レバレッジ比率 (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))	6.38%	5.61%
31a	連結レバレッジ比率 (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))	4.06%	3.71%

2024年6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。