

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9月末	2024年6月末
1	貸借対照表における総資産の額	34,106,388	37,128,443
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)	11,556,667	11,219,317
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	391,280	661,819
8a	デリバティブ取引等に関する額	1,196,751	1,674,658
8b	デリバティブ取引等に関連する資産の額(Δ)	805,470	1,012,839
9	レポ取引等に関する調整額	168,848	127,635
9a	レポ取引等に関する額	424,395	528,133
9b	レポ取引等に関する額(Δ)	255,547	400,498
10	オフ・バランス取引に関する額	2,267,340	2,630,468
11	Tier1資本に係る調整項目の額(貸倒引当金)(Δ)	8,035	9,827
12	その他の調整項目	Δ 742,239	Δ 1,367,966
12a	Tier1資本に係る調整項目の額(貸倒引当金以外)(Δ)	433,389	425,081
12b	支払承諾見返勘定の額(Δ)	34,376	36,751
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)	274,473	906,133
13	総エクスポージャーの額	24,626,914	27,951,255

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	21,454,325	24,459,037
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)	274,473	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)	8,035	9,827
6	Tier1資本に係る調整項目の額(貸倒引当金以外)(Δ)	433,389	425,081
7	オン・バランス資産の額 (イ)	20,738,427	23,117,994
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	417,841	886,831
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	778,910	787,827
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)	1,196,751	1,674,658
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	255,547	400,498
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	168,848	127,635
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)	424,395	528,133
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	2,877,175	3,336,733
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)	609,834	706,265
22	オフ・バランス取引に関する額 (ニ)	2,267,340	2,630,468
単体レバレッジ比率 (5)			
23	資本の額 (ホ)	1,945,253	1,950,423
24	総エクスポージャーの額((イ)+(ロ)+(ハ)+(ニ)) (ヘ)	24,626,914	27,951,255
25	単体レバレッジ比率((ホ)/(ヘ))	7.89%	6.97%
26	適用する所要単体レバレッジ比率	3.15%	3.15%
日本銀行に対する預け金を算入する場合の単体レバレッジ比率 (6)			
	総エクスポージャーの額 (ヘ)	24,626,914	27,951,255
	日本銀行に対する預け金の額	11,556,667	11,219,317
	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')	36,183,582	39,170,572
	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'))	5.37%	4.97%

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))	306,692	362,901
	レポ取引等に関する資産の額に係る平均値 (ト)	306,692	362,901
	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))	255,547	400,498
14	レポ取引等に関する資産の額に係る四半期末の値 (リ)	255,547	400,498
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)	24,678,059	27,913,658
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)	36,234,727	39,132,976
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))	7.88%	6.98%
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))	5.36%	4.98%

2024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。