

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12月末	2024年9月末
1	連結貸借対照表における総資産の額	40,692,909	39,433,895
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(Δ)	-	-
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)	13,987,106	14,927,626
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(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	328,681	325,984
	8a デリバティブ取引等に関する額	1,587,931	1,148,326
	8b デリバティブ取引等に関連する資産の額(Δ)	1,259,250	822,341
9	レボ取引等に関する調整額	319,352	216,238
	9a レボ取引等に関する額	846,530	784,460
	9b レボ取引等に関する額(Δ)	527,178	568,222
10	オフ・バランス取引に関する額	2,772,482	2,632,175
11	Tier1資本に係る調整項目の額(貸倒引当金)(Δ)	8,553	7,769
12	その他の調整項目	Δ 1,992,270	Δ 1,485,806
	12a Tier1資本に係る調整項目の額(貸倒引当金以外)(Δ)	1,133,719	1,181,101
	12b 支払承諾見返勘定の額(Δ)	32,268	30,672
	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)	826,282	274,032
	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	28,125,494	26,187,091

項番(国際 様式(LR2) の該当番 号)	項 目	2024年12月末	2024年9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	24,887,105	23,085,032
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)	826,282	274,032
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)	8,553	7,769
6	Tier1資本に係る調整項目の額(貸倒引当金以外)(Δ)	1,133,719	1,181,101
7	オン・バランス資産の額 (イ)	22,918,550	21,622,129
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	822,599	399,481
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	765,332	748,844
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)	1,587,931	1,148,326
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	527,178	568,222
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	319,352	216,238
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)	846,530	784,460
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	3,894,118	3,606,241
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)	1,121,636	974,065
22	オフ・バランス取引に関する額 (ニ)	2,772,482	2,632,175
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)	1,643,492	1,675,443
24	総エクスポージャーの額((イ)+(ロ)+(ハ)+(ニ)) (ヘ)	28,125,494	26,187,091
25	連結レバレッジ比率((ホ)/(ヘ))	5.84%	6.39%
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)	28,125,494	26,187,091
	日本銀行に対する預け金の額	13,987,106	14,927,626
	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')	42,112,601	41,114,718
	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'))	3.90%	4.07%

平均値の開示 (7)			
28	レボ取引等に関する資産の額(控除後)に係る平均値((ト)+(チ))	531,594	628,941
	レボ取引等に関する資産の額に係る平均値 (ト)	531,594	628,941
	レボ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	レボ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))	527,178	568,222
14	レボ取引等に関する資産の額に係る四半期末の値 (リ)	527,178	568,222
15	レボ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 (レボ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)	28,129,911	26,247,811
30a	総エクスポージャーの額 (レボ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)	42,117,017	41,175,437
31	連結レバレッジ比率 (レボ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))	5.84%	6.38%
31a	連結レバレッジ比率 (レボ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))	3.90%	4.06%

2024年9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低下は、主として有価証券の増加に伴う総エクスポージャーの額の増加によるもの。