

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6月末	2020年3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	21,038,049	29,698,780
1a	1	貸借対照表における総資産の額	22,359,127	31,034,919
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（△）	1,321,077	1,336,138
2	7	Tier1 資本に係る調整項目の額（△）	327,804	318,967
3		オン・バランス資産の額（イ）	20,710,244	29,379,812
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	127,859	121,680
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	236,162	257,712
		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	79,137	124,985
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（△）	18	52,472
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）	443,140	451,905
レポ取引等に関する額				
12		レポ取引等に関する資産の額	1,009,000	879,723
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	157,445	178,994
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）	1,166,446	1,058,718
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	1,706,272	1,690,544
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（△）	762,246	802,560
19	6	オフ・バランス取引に関する額（ニ）	944,025	887,984
単体レバレッジ比率				
20		資本の額（ホ）	1,976,252	1,867,723
21	8	総エクスポージャーの額（（イ）+（ロ）+（ハ）+（ニ））（ヘ）	23,263,857	31,778,420
22		単体レバレッジ比率（（ホ）/（ヘ））	8.49%	5.87%

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)	23,263,857
		日本銀行に対する預け金の額	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')	31,433,108
		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'))	6.28%

2020年3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、2019年(平成31年)金融庁告示第11号(以下、告示)において、2020年(令和2年)6月30日付告示改正に伴い、日本銀行に対する預け金の額が総エクスポージャーの額より除外されたことによるもの