

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	2021年6月末	2021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	20,642,844	21,070,575
1a	1	貸借対照表における総資産の額	21,447,320	22,158,444
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（△）	804,475	1,087,869
2	7	Tier1 資本に係る調整項目の額（△）	343,770	335,458
3		オン・バランス資産の額（イ）	20,299,074	20,735,117
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	111,995	267,703
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	252,562	236,369
		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	167,553	292,593
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	48
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）	532,092	796,617
レポ取引等に関する額				
12		レポ取引等に関する資産の額	371,006	329,698
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	101,004	139,784
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）	472,011	469,483
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	2,098,475	1,877,829
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（△）	968,878	815,233
19	6	オフ・バランス取引に関する額（ニ）	1,129,596	1,062,596
単体レバレッジ比率				
20		資本の額（ホ）	2,131,976	2,066,480
21	8	総エクスポージャーの額（(イ) + (ロ) + (ハ) + (ニ)）（ヘ）	22,432,775	23,063,815
22		単体レバレッジ比率（(ホ) / (ヘ)）	9.50%	8.95%

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)	22,432,775	23,063,815
		日本銀行に対する預け金の額	10,875,117	9,765,502
		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')	33,307,892	32,829,317
		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'))	6.40%	6.29%

2021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、利益積上げによる資本の増加およびオン・バランス資産を中心とした総エクスポージャーの減少によるもの。