

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、％）

国際様式 （表 2） の該当番 号	国際様式 （表 1） の該当番 号	項 目	2022年3月末	2021年12月末
<b>オン・バランス資産の額</b>				
1		調整項目控除前のオン・バランス資産の額	23,629,231	23,818,551
1a	1	連結貸借対照表における総資産の額	25,788,348	24,878,834
1b	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（△）	-	-
1c	7	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。）	-	-
1d	3	連結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（△）	2,159,116	1,060,283
2	7	Tier1 資本に係る調整項目の額（△）	679,614	666,305
3		オン・バランス資産の額（イ）	22,949,617	23,152,245
<b>デリバティブ取引等に関する額</b>				
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	505,997	161,187
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	298,187	286,424
		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	792,383	213,946
6		連結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	-	-
		連結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（△）	162	29
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）	1,596,406	661,527
<b>レポ取引等に関する額</b>				
12		レポ取引等に関する資産の額	538,880	429,420
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	227,689	260,646
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）	766,570	690,066
<b>オフ・バランス取引に関する額</b>				
17		オフ・バランス取引の想定元本の額	2,533,291	2,497,250
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（△）	1,217,375	1,229,602
19	6	オフ・バランス取引に関する額（ニ）	1,315,916	1,267,648
<b>連結レバレッジ比率</b>				
20		資本の額（ホ）	1,803,306	1,954,864
21	8	総エクスポージャーの額（（イ）+（ロ）+（ハ）+（ニ））（ヘ）	26,628,510	25,771,488
22		連結レバレッジ比率（（ホ）/（ヘ））	6.77%	7.58%

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				
		総エクスポージャーの額 (へ)	26,628,510	25,771,488
		日本銀行に対する預け金の額	17,041,725	13,878,282
		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')	43,670,236	39,649,771
		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) / (へ'))	4.12%	4.93%

**2021年12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、主としてその他有価証券評価差額金の減少に伴う資本の額の減少によるもの。