

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12月末	2024年9月末
1	貸借対照表における総資産の額	35,491,909	34,106,388
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)	10,987,671	11,556,667
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	568,533	391,280
8a	デリバティブ取引等に関する額	1,813,599	1,196,751
8b	デリバティブ取引等に関連する資産の額(Δ)	1,245,066	805,470
9	レボ取引等に関する調整額	212,209	168,848
9a	レボ取引等に関する額	513,650	424,395
9b	レボ取引等に関する額(Δ)	301,440	255,547
10	オフ・バランス取引に関する額	2,377,195	2,267,340
11	Tier1資本に係る調整項目の額(貸倒引当金)(Δ)	8,906	8,035
12	その他の調整項目	Δ 1,318,331	Δ 742,239
12a	Tier1資本に係る調整項目の額(貸倒引当金以外)(Δ)	444,119	433,389
12b	支払承諾見返勘定の額(Δ)	47,930	34,376
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	274,473
13	総エクスポージャーの額	26,334,937	24,626,914

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	22,909,799	21,454,325
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	274,473
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)	8,906	8,035
6	Tier1資本に係る調整項目の額(貸倒引当金以外)(Δ)	444,119	433,389
7	オン・バランス資産の額 (イ)	21,630,491	20,738,427
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	1,021,914	417,841
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	791,684	778,910
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)	1,813,599	1,196,751
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	301,440	255,547
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	212,209	168,848
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)	513,650	424,395
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	3,099,965	2,877,175
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)	722,769	609,834
22	オフ・バランス取引に関する額 (ニ)	2,377,195	2,267,340
単体レバレッジ比率 (5)			
23	資本の額 (ホ)	1,930,058	1,945,253
24	総エクスポージャーの額((イ)+(ロ)+(ハ)+(ニ)) (ヘ)	26,334,937	24,626,914
25	単体レバレッジ比率((ホ)/(ヘ))	7.32%	7.89%
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)	26,334,937	24,626,914
	日本銀行に対する預け金の額	10,987,671	11,556,667
	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')	37,322,609	36,183,582
	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'))	5.17%	5.37%

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))	286,519	306,692
	レボ取引等に関する資産の額に係る平均値 (ト)	286,519	306,692
	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))	301,440	255,547
14	レボ取引等に関する資産の額に係る四半期末の値 (リ)	301,440	255,547
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)	26,320,016	24,678,059
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)	37,307,687	36,234,727
31	単体レバレッジ比率 (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))	7.33%	7.88%
31a	単体レバレッジ比率 (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))	5.17%	5.36%

2024年9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。