

2020年2月13日

各位

三井住友トラスト・ホールディングス株式会社
三井住友信託銀行株式会社

流動性カバレッジ比率の訂正について

三井住友トラスト・ホールディングス株式会社の連結流動性カバレッジ比率、三井住友信託銀行株式会社の連結及び単体流動性カバレッジ比率について、誤りがございましたので、お詫びいたしますとともに、下記の通り訂正させていただきます。

また、訂正に際しては、訂正対象箇所について金融庁告示に定められた方法による算出に必要なデータの一部を保持していないことから、日次データを用いるべき項目の一部を月末データで代用し算出しておりますが、当該手法を用いることの妥当性については検証のうえ確認を行っております。

なお訂正後においても、当グループとしては、いずれの期間においても銀行法に定める規制値を上回る水準を十分に確保していることを確認しており、流動性リスクに懸念はございません。

記

1. 概要(両社共通)

預金等に係る属性判定に不備があり、各期における純資金流出額が過少に計上されていたことから、流動性カバレッジ比率が誤って算出されていたもの。

2. 訂正対象

各種開示資料の訂正については、銀行法に基づき備置しているディスクロージャー誌の記載範囲に則し、2017年度第4四半期から2019年度第2四半期を対象といたします。

(1) ディスクロージャー誌、アニュアルレポート

対象資料	(i) 2019 ディスクロージャー誌 資料編 (ii) 2019 中間期ディスクロージャー誌 (iii) 2019 Annual Report - Financial Data Section
------	---

(2) バーゼルⅢ関連データ

対象資料	2017年度第4四半期から2019年度第2四半期における (i) 主要な指標(流動性カバレッジ比率の推移) (ii) 流動性カバレッジ比率
------	---

(3) IR資料

対象資料	2017年度(通期決算)から2019年度中間期における (i) 決算説明会資料 (ii) 決算の概要
------	--

上記(1)～(3)の訂正後の資料又は正誤表を当グループのウェブサイトにて掲載しております。

3. 影響の概要

- (1) 三井住友トラスト・ホールディングス株式会社(連結) …別紙ご参照
- (2) 三井住友信託銀行株式会社(連結) …別紙ご参照
- (3) 三井住友信託銀行株式会社(単体) …別紙ご参照

以上

(1) 三井住友トラスト・ホールディングス株式会社(連結)

【正】	(単位: 百万円、%)						
	2019年度 第2四半期	2019年度 第1四半期	2018年度 第4四半期	2018年度 第3四半期	2018年度 第2四半期	2018年度 第1四半期	2017年度 第4四半期
算入可能適格流動性資産の合計額	15,446,412	15,297,151	15,231,564	16,267,668	28,164,041	28,382,568	27,250,018
純資金流出額	11,469,926	12,470,590	11,951,199	11,878,550	23,118,469	22,653,060	20,657,115
連結流動性カバレッジ比率	134.6%	122.6%	127.4%	136.9%	121.8%	125.2%	131.9%

(注) 上記期間において、日次データを用いるべき項目の一部を月末データで代用し算出しております。

【誤】	(単位: 百万円、%)						
	2019年度 第2四半期	2019年度 第1四半期	2018年度 第4四半期	2018年度 第3四半期	2018年度 第2四半期	2018年度 第1四半期	2017年度 第4四半期
算入可能適格流動性資産の合計額	15,448,515	15,299,271	15,232,871	16,267,668	28,164,041	28,382,568	27,250,018
純資金流出額	9,875,908	10,495,384	10,199,464	9,817,443	21,360,394	20,468,187	19,016,174
連結流動性カバレッジ比率	156.4%	145.7%	149.3%	165.7%	131.8%	138.6%	143.2%

(2) 三井住友信託銀行株式会社(連結)

【正】	(単位: 百万円、%)						
	2019年度 第2四半期	2019年度 第1四半期	2018年度 第4四半期	2018年度 第3四半期	2018年度 第2四半期	2018年度 第1四半期	2017年度 第4四半期
算入可能適格流動性資産の合計額	15,446,412	15,297,151	15,231,564	16,267,668	16,132,916	15,641,897	15,286,840
純資金流出額	11,584,160	12,552,800	12,064,738	11,964,602	11,904,442	10,602,813	9,342,282
連結流動性カバレッジ比率	133.3%	121.8%	126.2%	135.9%	135.5%	147.5%	163.6%

(注) 上記期間において、日次データを用いるべき項目の一部を月末データで代用し算出しております。

【誤】	(単位: 百万円、%)						
	2019年度 第2四半期	2019年度 第1四半期	2018年度 第4四半期	2018年度 第3四半期	2018年度 第2四半期	2018年度 第1四半期	2017年度 第4四半期
算入可能適格流動性資産の合計額	15,448,515	15,299,271	15,232,871	16,267,668	16,132,916	15,641,897	15,286,840
純資金流出額	9,990,141	10,589,832	10,313,003	9,903,496	10,146,366	8,417,938	7,701,341
連結流動性カバレッジ比率	154.6%	144.4%	147.7%	164.2%	159.0%	185.8%	198.4%

(3) 三井住友信託銀行株式会社(単体)

【正】	(単位: 百万円、%)						
	2019年度 第2四半期	2019年度 第1四半期	2018年度 第4四半期	2018年度 第3四半期	2018年度 第2四半期	2018年度 第1四半期	2017年度 第4四半期
算入可能適格流動性資産の合計額	15,251,414	15,100,550	15,076,420	16,072,242	15,942,059	15,453,890	15,114,946
純資金流出額	10,783,358	11,388,356	11,067,028	11,034,546	10,896,775	9,621,642	8,484,060
単体流動性カバレッジ比率	141.4%	132.5%	136.2%	145.6%	146.3%	160.6%	178.1%

(注) 上記期間において、日次データを用いるべき項目の一部を月末データで代用し算出しております。

【誤】	(単位: 百万円、%)						
	2019年度 第2四半期	2019年度 第1四半期	2018年度 第4四半期	2018年度 第3四半期	2018年度 第2四半期	2018年度 第1四半期	2017年度 第4四半期
算入可能適格流動性資産の合計額	15,253,517	15,102,670	15,077,727	16,072,242	15,942,059	15,453,890	15,114,946
純資金流出額	9,189,339	9,372,620	9,315,292	8,973,441	9,138,699	7,436,769	6,843,119
単体流動性カバレッジ比率	165.9%	161.1%	161.8%	179.1%	174.4%	207.8%	220.8%