三井住友トラスト・ホールディングス株式会社

正誤表

「2019 中間期ディスクロージャー誌」の記載に一部誤りがございましたので、お詫び申し上げますとともに、以下のとおり訂正いたします。

＜訂正箇所および訂正内容（2021 年 1 月訂正）＞

P114　三井住友信託銀行　決算データ

単体：銀行業務の状況

（8）貸出金の担保別内訳

【誤】

（単位：百万円）

	2018 年 9 月末	2019 年 9 月末
有価証券	565, 104	651, 235
債権	364, 296	274, 241
土地建物	2, 820, 490	3, 206, 905
工場	62, 022	101, 946
財団	189, 851	175, 589
船舶・航空機	1, 090, 582	1, 132, 468
その他	1, 461, 263	1, 586, 548
小計	6, 553, 610	7, 128, 935
保証	8, 894, 414	9, 041, 356
信用	13, 422, 873	13, 109, 768
合計	28, 870, 898	29, 280, 061

【正】

（単位：百万円）

	2018 年 9 月末	2019 年 9 月末
有価証券	565, 104	651, 235
債権	364, 296	274, 241
土地建物	**2, 241, 492**	**2, 381, 035**
工場	62, 022	101, 946
財団	189, 851	175, 589
船舶・航空機	1, 090, 582	1, 132, 468
その他	1, 461, 263	1, 586, 548
小計	**5, 974, 612**	**6, 303, 066**
保証	**9, 473, 412**	**9, 867, 226**
信用	13, 422, 873	13, 109, 768
合計	28, 870, 898	29, 280, 061

＜訂正箇所および訂正内容（2020 年 2 月訂正）＞

P128　三井住友トラスト・ホールディングス　　バーゼルⅢ関連データ

連結：KM1

KM1：主要な指標

【誤】

（単位：百万円、%）

KM1						
国際様式の該当番号		イ	ロ	ハ	ニ	ホ
		2019 年 9 月末	2019 年 6 月末	2019 年 3 月末	2018 年 12 月末	2018 年 9 月末
資本						
1	普通株式等 Tier1 資本の額	2,452,519	2,423,767	2,412,110	2,380,884	2,353,897
2	Tier1 資本の額	2,805,439	2,817,576	2,806,512	2,774,428	2,748,224
3	総自己資本の額	3,328,099	3,351,100	3,320,139	3,297,602	3,301,843
リスク・アセット						
4	リスク・アセットの額	19,010,206	19,336,412	19,790,115	19,325,145	19,971,261
自己資本比率						
5	連結普通株式等 Tier1 比率	12.90%	12.53%	12.18%	12.32%	11.78%
6	連結 Tier1 比率	14.75%	14.57%	14.18%	14.35%	13.76%
7	連結総自己資本比率	17.50%	17.33%	16.77%	17.06%	16.53%
資本バッファー						
8	資本保全バッファー比率	2.50%	2.50%	2.50%	1.87%	1.87%
9	カウンター・シクリカル・バッファー比率	0.02%	0.03%	0.03%	0.02%	―%
10	G-SIB/D-SIB バッファー比率	0.50%	0.50%	0.50%	0.37%	0.37%
11	最低連結資本バッファー比率	3.02%	3.03%	3.03%	2.27%	2.25%
12	連結資本バッファー比率	8.40%	8.03%	7.68%	7.82%	7.28%
持株レバレッジ比率						
13	総エクスポージャーの額	60,114,680	59,077,414	60,009,211	59,557,896	72,436,378
14	持株レバレッジ比率	4.66%	4.76%	4.67%	4.65%	3.79%

（単位：百万円、%）

KM1						
国際様式の該当番号		イ	ロ	ハ	ニ	ホ
		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
連結流動性カバレッジ比率						
15	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
16	純資金流出額	9,875,908	10,495,384	10,199,464	9,817,443	21,360,394
17	連結流動性カバレッジ比率	156.4%	145.7%	149.3%	165.7%	131.8%

【正】

（単位：百万円、%）

KM1						
国際様式の該当番号		イ	ロ	ハ	ニ	ホ
		2019年9月末	2019年6月末	2019年3月末	2018年12月末	2018年9月末
資本						
1	普通株式等Tier1資本の額	2,452,519	2,423,767	2,412,110	2,380,884	2,353,897
2	Tier1資本の額	2,805,439	2,817,576	2,806,512	2,774,428	2,748,224
3	総自己資本の額	3,328,099	3,351,100	3,320,139	3,297,602	3,301,843
リスク・アセット						
4	リスク・アセットの額	19,010,206	19,336,412	19,790,115	19,325,145	19,971,261
自己資本比率						
5	連結普通株式等Tier1比率	12.90%	12.53%	12.18%	12.32%	11.78%
6	連結Tier1比率	14.75%	14.57%	14.18%	14.35%	13.76%
7	連結総自己資本比率	17.50%	17.33%	16.77%	17.06%	16.53%
資本バッファー						
8	資本保全バッファー比率	2.50%	2.50%	2.50%	1.87%	1.87%
9	カウンター・シクリカル・バッファー比率	0.02%	0.03%	0.03%	0.02%	－%
10	G-SIB/D-SIB バッファー比率	0.50%	0.50%	0.50%	0.37%	0.37%
11	最低連結資本バッファー比率	3.02%	3.03%	3.03%	2.27%	2.25%
12	連結資本バッファー比率	8.40%	8.03%	7.68%	7.82%	7.28%
持株レバレッジ比率						
13	総エクスポージャーの額	60,114,680	59,077,414	60,009,211	59,557,896	72,436,378
14	持株レバレッジ比率	4.66%	4.76%	4.67%	4.65%	3.79%

（単位：百万円、%）

KM1						
国際様式の該当番号		イ	ロ	ハ	ニ	ホ
		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
連結流動性カバレッジ比率						
15	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
16	純資金流出額	11,469,926	12,470,590	11,951,199	11,878,550	23,118,469
17	連結流動性カバレッジ比率	134.6%	122.6%	127.4%	136.9%	121.8%

（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。

P182　三井住友トラスト・ホールディングス　　バーゼルⅢ関連データ

連結：流動性カバレッジ比率

連結流動性カバレッジ比率に関する開示事項

連結流動性カバレッジ比率に関する定量的開示事項

【誤】

（単位：百万円、%、件）

項目		2019年度第2四半期		2019年度第1四半期	
適格流動資産（1）					
1	適格流動資産の合計額	15,448,515		15,299,271	
資金流出額（2）		資金流出率を乗じる前の額	資金流出率を乗じた後の額	資金流出率を乗じる前の額	資金流出率を乗じた後の額
2	リテール無担保資金調達に係る資金流出額	17,597,966	821,685	17,505,539	816,080
3	うち、安定預金の額	695,051	20,851	675,158	20,254
4	うち、準安定預金の額	7,967,809	800,833	7,915,887	795,825
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	13,133,457	9,391,663	13,578,165	9,748,561
6	うち、適格オペレーショナル預金の額	0	0	0	0
7	うち、適格オペレーショナル預金、負債性有価証券以外のホールセール無担保資金調達に係る資金の額	10,624,976	6,883,182	11,037,693	7,208,089
8	うち、負債性有価証券の額	2,508,481	2,508,481	2,540,472	2,540,472
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		188,060		114,991
10	デリバティブ取引等、資金調達プログラム、与信・流動性ファシリティに係る資金流出額	5,393,887	1,227,926	5,522,638	1,220,755
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	370,861	370,861	337,896	337,896
12	うち、資金調達プログラムに係る資金流出額	0	0	0	0
13	うち、与信・流動性ファシリティに係る資金流出額	5,023,026	857,065	5,184,742	882,859
14	資金提供義務等に基づく資金流出額	462,146	338,979	606,549	499,522
15	偶発事象に係る資金流出額	11,155,410	24,258	11,122,717	24,752
16	資金流出合計額		11,992,571		12,424,661
資金流入額（3）		資金流入率を乗じる前の額	資金流入率を乗じた後の額	資金流入率を乗じる前の額	資金流入率を乗じた後の額
17	有担保資金運用等に係る資金流入額	69,457	0	81,355	0
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	2,669,522	1,828,131	2,485,702	1,716,592
19	その他資金流入額	455,235	288,532	302,244	212,685
20	資金流入合計額	3,194,214	2,116,663	2,869,301	1,929,277
連結流動性カバレッジ比率（4）					
21	算入可能適格流動資産の合計額		15,448,515		15,299,271
22	純資金流出額		9,875,908		10,495,384
23	連結流動性カバレッジ比率		156.4		145.7
24	平均値計算用データ数		62		59

連結流動性カバレッジ比率に関する定性的開示事項

(1) 時系列における連結流動性カバレッジ比率の変動に関する事項

当社連結における過去2年間の流動性カバレッジ比率は、概ね安定的に推移しております。

なお、2018年度第3四半期につきましては、当社連結範囲の変更により上昇したものとなります。

(2) 連結流動性カバレッジ比率の水準の評価に関する事項

当社連結の流動性カバレッジ比率は所要水準を十分に満たしており、今後も現在の水準から大きくかい離することは想定しておりません。

また、実績値は当初の見通しと大きく異なっておりません。

(3) 算入可能適格流動資産の合計額の内容に関する事項

算入可能適格流動資産は中央銀行への預け金、国債等が大半を占めております。通貨または種類等の構成や所在地に著しい変動は発生しておりません。また、主要な通貨において、算入可能適格流動資産の合計額と純資金流出額の間に著しい通貨のミスマッチは発生しておりません。

(4) その他連結流動性カバレッジ比率に関する事項

当社連結では、「適格オペレーショナル預金に係る特例」および「シナリオ法による時価変動時所要追加担保額」を適用しておりません。

なお、連結流動性カバレッジ比率に与える影響に鑑み、重要性が低く、かつ、実務上の制約がある連結子会社については、日次データに代えて月末データを使用しております。

【正】

（単位：百万円、%、

項目		2019年度第2四半期		2019年度第1四半期	
適格流動資産（1）					
1	適格流動資産の合計額		15,446,412		15,297,151
資金流出額（2）		資金流出率を乗じる前の額	資金流出率を乗じた後の額	資金流出率を乗じる前の額	資金流出率を乗じた後の額
2	リテール無担保資金調達に係る資金流出額	17,597,966	821,685	17,505,449	816,053
3	うち、安定預金の額	695,051	20,851	675,158	20,254
4	うち、準安定預金の額	7,967,809	800,833	7,915,797	795,798
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	13,133,457	10,630,331	13,536,000	11,410,062
6	うち、適格オペレーショナル預金の額	0	0	0	0
7	うち、適格オペレーショナル預金、負債性有価証券以外のホールセール無担保資金調達に係る資金の額	10,624,976	8,121,850	10,995,528	8,869,590
8	うち、負債性有価証券の額	2,508,481	2,508,481	2,540,472	2,540,472
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		188,060		114,991
10	デリバティブ取引等、資金調達プログラム、与信・流動性ファシリティに係る資金流出額	5,393,887	1,617,986	5,522,638	1,610,815
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	370,861	370,861	337,896	337,896
12	うち、資金調達プログラムに係る資金流出額	0	0	0	0
13	うち、与信・流動性ファシリティに係る資金流出額	5,023,026	1,247,125	5,184,742	1,272,919
14	資金提供義務等に基づく資金流出額	462,146	338,979	606,273	499,246
15	偶発事象に係る資金流出額	11,155,410	24,258	11,122,717	24,752
16	資金流出合計額		13,621,299		14,475,919
資金流入額（3）		資金流入率を乗じる前の額	資金流入率を乗じた後の額	資金流入率を乗じる前の額	資金流入率を乗じた後の額
17	有担保資金運用等に係る資金流入額	69,457	0	81,355	0
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	2,669,521	1,862,841	2,483,701	1,792,644
19	その他資金流入額	455,235	288,532	302,244	212,685
20	資金流入合計額	3,194,213	2,151,373	2,867,300	2,005,329
連結流動性カバレッジ比率（4）					
21	算入可能適格流動資産の合計額		15,446,412		15,297,151
22	純資金流出額		11,469,926		12,470,590
23	連結流動性カバレッジ比率		134.6		122.6
24	平均値計算用データ数		62		59

（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。

連結流動性カバレッジ比率に関する定性的開示事項

(1) 時系列における連結流動性カバレッジ比率の変動に関する事項

当社連結における過去2年間の流動性カバレッジ比率は、概ね安定的に推移しております。

なお、2018年度第3四半期につきましては、当社連結範囲の変更により上昇したものとなります。

(2) 連結流動性カバレッジ比率の水準の評価に関する事項

当社連結の流動性カバレッジ比率は所要水準を十分に満たしており、今後も現在の水準から大きくかい離することは想定しておりません。

また、実績値は当初の見通しと大きく異なっておりません。

(3) 算入可能適格流動資産の合計額の内容に関する事項

算入可能適格流動資産は中央銀行への預け金、国債等が大半を占めております。通貨または種類等の構成や所在地に著しい変動は発生しておりません。また、主要な通貨において、算入可能適格流動資産の合計額と純資金流出額の間に著しい通貨のミスマッチは発生しておりません。

(4) その他連結流動性カバレッジ比率に関する事項

当社連結では、「適格オペレーショナル預金に係る特例」および「シナリオ法による時価変動時所要追加担保額」を適用しておりません。

なお、連結流動性カバレッジ比率に与える影響に鑑み、重要性が低く、かつ、実務上の制約がある連結子会社については、日次データに代えて月末データを使用しております。

P184　三井住友信託銀行　　バーゼルⅢ関連データ

連結：KM1

KM1：主要な指標

【誤】

（単位：百万円、%）

KM1						
国際様式の該当番号		イ	ロ	ハ	ニ	ホ
		2019年9月末	2019年6月末	2019年3月末	2018年12月末	2018年9月末
資本						
1	普通株式等Tier1資本の額	2,115,555	2,087,033	2,068,239	2,201,397	2,204,938
2	Tier1資本の額	2,466,947	2,439,841	2,421,640	2,553,940	2,557,849
3	総自己資本の額	2,989,248	2,973,365	2,935,268	3,077,114	3,110,914
リスク・アセット						
4	リスク・アセットの額	18,667,159	19,109,831	19,529,822	19,111,660	19,861,313
自己資本比率						
5	連結普通株式等Tier1比率	11.33%	10.92%	10.59%	11.51%	11.10%
6	連結Tier1比率	13.21%	12.76%	12.39%	13.36%	12.87%
7	連結総自己資本比率	16.01%	15.55%	15.02%	16.10%	15.66%
連結レバレッジ比率						
13	総エクスポージャーの額	59,946,397	58,982,403	59,930,811	59,454,139	59,627,501
14	連結レバレッジ比率	4.11%	4.13%	4.04%	4.29%	4.28%

（単位：百万円、%）

KM1						
国際様式の該当番号		イ	ロ	ハ	ニ	ホ
		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
連結流動性カバレッジ比率						
15	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
16	純資金流出額	9,990,141	10,589,832	10,313,003	9,903,496	10,146,366
17	連結流動性カバレッジ比率	154.6%	144.4%	147.7%	164.2%	159.0%

【正】

（単位：百万円、%）

KM1						
国際様式の該当番号		イ	ロ	ハ	ニ	ホ
		2019年9月末	2019年6月末	2019年3月末	2018年12月末	2018年9月末
資本						
1	普通株式等Tier1資本の額	2,115,555	2,087,033	2,068,239	2,201,397	2,204,938
2	Tier1資本の額	2,466,947	2,439,841	2,421,640	2,553,940	2,557,849
3	総自己資本の額	2,989,248	2,973,365	2,935,268	3,077,114	3,110,914
リスク・アセット						
4	リスク・アセットの額	18,667,159	19,109,831	19,529,822	19,111,660	19,861,313
自己資本比率						
5	連結普通株式等Tier1比率	11.33%	10.92%	10.59%	11.51%	11.10%
6	連結Tier1比率	13.21%	12.76%	12.39%	13.36%	12.87%
7	連結総自己資本比率	16.01%	15.55%	15.02%	16.10%	15.66%
連結レバレッジ比率						
13	総エクスポージャーの額	59,946,397	58,982,403	59,930,811	59,454,139	59,627,501
14	連結レバレッジ比率	4.11%	4.13%	4.04%	4.29%	4.28%

（単位：百万円、%）

KM1						
国際様式の該当番号		イ	ロ	ハ	ニ	ホ
		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
連結流動性カバレッジ比率						
15	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
16	純資金流出額	11,584,160	12,552,800	12,064,738	11,964,602	11,904,442
17	連結流動性カバレッジ比率	133.3%	121.8%	126.2%	135.9%	135.5%

（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。

P240　三井住友信託銀行　　バーゼルⅢ関連データ

連結：流動性カバレッジ比率

連結流動性カバレッジ比率に関する開示事項

連結流動性カバレッジ比率に関する定量的開示事項

【誤】

（単位：百万円、%、件）

項目		2019年度第2四半期		2019年度第1四半期	
適格流動資産（1）					
1	適格流動資産の合計額	15,448,515		15,299,271	
資金流出額（2）		資金流出率を乗じる前の額	資金流出率を乗じた後の額	資金流出率を乗じる前の額	資金流出率を乗じた後の額
2	リテール無担保資金調達に係る資金流出額	17,597,966	821,685	17,505,539	816,080
3	うち、安定預金の額	695,051	20,851	675,158	20,254
4	うち、準安定預金の額	7,967,809	800,833	7,915,887	795,825
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	13,266,819	9,524,832	13,680,889	9,850,997
6	うち、適格オペレーショナル預金の額	0	0	0	0
7	うち、適格オペレーショナル預金、負債性有価証券以外のホールセール無担保資金調達に係る資金の額	10,654,241	6,912,254	11,068,146	7,238,254
8	うち、負債性有価証券の額	2,612,578	2,612,578	2,612,743	2,612,743
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		188,060		114,991
10	デリバティブ取引等、資金調達プログラム、与信・流動性ファシリティに係る資金流出額	5,397,274	1,229,281	5,522,638	1,220,755
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	370,861	370,861	337,896	337,896
12	うち、資金調達プログラムに係る資金流出額	0	0	0	0
13	うち、与信・流動性ファシリティに係る資金流出額	5,026,413	858,420	5,184,742	882,859
14	資金提供義務等に基づく資金流出額	441,855	318,688	598,561	491,534
15	偶発事象に係る資金流出額	11,155,410	24,258	11,122,717	24,752
16	資金流出合計額		12,106,804		12,519,109
資金流入額（3）		資金流入率を乗じる前の額	資金流入率を乗じた後の額	資金流入率を乗じる前の額	資金流入率を乗じた後の額
17	有担保資金運用等に係る資金流入額	69,457	0	81,355	0
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	2,669,522	1,828,131	2,485,702	1,716,592
19	その他資金流入額	455,235	288,532	302,244	212,685
20	資金流入合計額	3,194,214	2,116,663	2,869,301	1,929,277
連結流動性カバレッジ比率（4）					
21	算入可能適格流動資産の合計額		15,448,515		15,299,271
22	純資金流出額		9,990,141		10,589,832
23	連結流動性カバレッジ比率		154.6		144.4
24	平均値計算用データ数	62		59	

連結流動性カバレッジ比率に関する定性的開示事項

(1) 時系列における連結流動性カバレッジ比率の変動に関する事項

当社連結における過去2年間の流動性カバレッジ比率は、概ね安定的に推移しております。

(2) 連結流動性カバレッジ比率の水準の評価に関する事項

当社連結の流動性カバレッジ比率は所要水準を十分に満たしており、今後も現在の水準から大きくかい離することは想定しておりません。

また、実績値は当初の見通しと大きく異なっておりません。

(3) 算入可能適格流動資産の合計額の内容に関する事項

算入可能適格流動資産は中央銀行への預け金、国債等が大半を占めております。通貨または種類等の構成や所在地に著しい変動は発生しておりません。また、主要な通貨において、算入可能適格流動資産の合計額と純資金流出額の間に著しい通貨のミスマッチは発生しておりません。

(4) その他連結流動性カバレッジ比率に関する事項

当社連結では、「適格オペレーショナル預金に係る特例」および「シナリオ法による時価変動時所要追加担保額」を適用しておりません。

なお、連結流動性カバレッジ比率に与える影響に鑑み、重要性が低く、かつ、実務上の制約がある連結子会社については、日次データに代えて月末データを使用しております。

【正】

（単位：百万円、%、件）

項目		2019年度第2四半期		2019年度第1四半期	
適格流動資産（1）					
1	適格流動資産の合計額		15,446,412		15,297,151
資金流出額（2）		資金流出率を乗じる前の額	資金流出率を乗じた後の額	資金流出率を乗じる前の額	資金流出率を乗じた後の額
2	リテール無担保資金調達に係る資金流出額	17,597,966	821,685	17,505,449	816,053
3	うち、安定預金の額	695,051	20,851	675,158	20,254
4	うち、準安定預金の額	7,967,809	800,833	7,915,797	795,798
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	13,266,820	10,763,501	13,638,724	11,512,497
6	うち、適格オペレーショナル預金の額	0	0	0	0
7	うち、適格オペレーショナル預金、負債性有価証券以外のホールセール無担保資金調達に係る資金の額	10,654,242	8,150,923	11,025,981	8,899,754
8	うち、負債性有価証券の額	2,612,578	2,612,578	2,612,743	2,612,743
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		188,060		114,991
10	デリバティブ取引等、資金調達プログラム、与信・流動性ファシリティに係る資金流出額	5,397,274	1,619,341	5,522,638	1,610,815
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	370,861	370,861	337,896	337,896
12	うち、資金調達プログラムに係る資金流出額	0	0	0	0
13	うち、与信・流動性ファシリティに係る資金流出額	5,026,413	1,248,480	5,184,742	1,272,919
14	資金提供義務等に基づく資金流出額	441,855	318,688	586,048	479,021
15	偶発事象に係る資金流出額	11,155,410	24,258	11,122,717	24,752
16	資金流出合計額		13,735,533		14,558,129
資金流入額（3）		資金流入率を乗じる前の額	資金流入率を乗じた後の額	資金流入率を乗じる前の額	資金流入率を乗じた後の額
17	有担保資金運用等に係る資金流入額	69,457	0	81,355	0
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	2,669,521	1,862,841	2,483,701	1,792,644
19	その他資金流入額	455,235	288,532	302,244	212,685
20	資金流入合計額	3,194,213	2,151,373	2,867,300	2,005,329
連結流動性カバレッジ比率（4）					
21	算入可能適格流動資産の合計額		15,446,412		15,297,151
22	純資金流出額		11,584,160		12,552,800
23	連結流動性カバレッジ比率		133.3		121.8
24	平均値計算用データ数		62		59

（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。

連結流動性カバレッジ比率に関する定性的開示事項

(1) 時系列における連結流動性カバレッジ比率の変動に関する事項

当社連結における過去2年間の流動性カバレッジ比率は、概ね安定的に推移しております。

(2) 連結流動性カバレッジ比率の水準の評価に関する事項

当社連結の流動性カバレッジ比率は所要水準を十分に満たしており、今後も現在の水準から大きくかい離することは想定しておりません。また、実績値は当初の見通しと大きく異なっておりません。

(3) 算入可能適格流動資産の合計額の内容に関する事項

算入可能適格流動資産は中央銀行への預け金、国債等が大半を占めております。通貨または種類等の構成や所在地に著しい変動は発生しておりません。また、主要な通貨において、算入可能適格流動資産の合計額と純資金流出額の間に著しい通貨のミスマッチは発生しておりません。

(4) その他連結流動性カバレッジ比率に関する事項

当社連結では、「適格オペレーショナル預金に係る特例」および「シナリオ法による時価変動時所要追加担保額」を適用しておりません。なお、連結流動性カバレッジ比率に与える影響に鑑み、重要性が低く、かつ、実務上の制約がある連結子会社については、日次データに代えて月末データを使用しております。

P241　三井住友信託銀行　　バーゼルⅢ関連データ

単体：KM1

KM1：主要な指標

【誤】

（単位：百万円、%）

KM1						
国際様式の該当番号		イ	ロ	ハ	ニ	ホ
		2019年9月末	2019年6月末	2019年3月末	2018年12月末	2018年9月末
資本						
1	普通株式等Tier1資本の額	1,912,687	1,930,945	1,919,843	2,093,433	2,105,502
2	Tier1資本の額	2,252,687	2,270,945	2,259,843	2,433,433	2,445,502
3	総自己資本の額	2,769,965	2,798,706	2,767,568	2,951,012	2,993,154
リスク・アセット						
4	リスク・アセットの額	18,149,949	18,550,949	19,152,340	18,580,794	19,426,260
自己資本比率						
5	普通株式等Tier1比率	10.53%	10.40%	10.02%	11.26%	10.83%
6	Tier1比率	12.41	12.24%	11.79%	13.09%	12.58%
7	総自己資本比率	15.26%	15.08%	14.45%	15.88%	15.40%
単体レバレッジ比率						
13	総エクスポージャーの額	58,115,701	57,098,271	58,241,947		
14	単体レバレッジ比率	3.87%	3.97%	3.88%		

（単位：百万円、%）

KM1						
国際様式の該当番号		イ	ロ	ハ	ニ	ホ
		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
単体流動性カバレッジ比率						
15	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
16	純資金流出額	9,189,339	9,372,620	9,315,292	8,973,441	9,138,699
17	単体流動性カバレッジ比率	165.9%	161.1%	161.8%	179.1%	174.4%

【正】

（単位：百万円、%）

KM1						
国際様式の該当番号		イ	ロ	ハ	ニ	ホ
		2019年9月末	2019年6月末	2019年3月末	2018年12月末	2018年9月末
資本						
1	普通株式等Tier1資本の額	1,912,687	1,930,945	1,919,843	2,093,433	2,105,502
2	Tier1資本の額	2,252,687	2,270,945	2,259,843	2,433,433	2,445,502
3	総自己資本の額	2,769,965	2,798,706	2,767,568	2,951,012	2,993,154
リスク・アセット						
4	リスク・アセットの額	18,149,949	18,550,949	19,152,340	18,580,794	19,426,260
自己資本比率						
5	普通株式等Tier1比率	10.53%	10.40%	10.02%	11.26%	10.83%
6	Tier1比率	12.41	12.24%	11.79%	13.09%	12.58%
7	総自己資本比率	15.26%	15.08%	14.45%	15.88%	15.40%
単体レバレッジ比率						
13	総エクスポージャーの額	58,115,701	57,098,271	58,241,947		
14	単体レバレッジ比率	3.87%	3.97%	3.88%		

（単位：百万円、%）

KM1						
国際様式の該当番号		イ	ロ	ハ	ニ	ホ
		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
単体流動性カバレッジ比率						
15	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
16	純資金流出額	10,783,358	11,388,356	11,067,028	11,034,546	10,896,775
17	単体流動性カバレッジ比率	141.4%	132.5%	136.2%	145.6%	146.3%

（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。

P258　三井住友信託銀行　　バーゼルⅢ関連データ

単体：流動性カバレッジ比率

単体流動性カバレッジ比率に関する開示事項

単体流動性カバレッジ比率に関する定量的開示事項

【誤】

（単位：百万円、%、件）

項目		2019 年度第 2 四半期		2019 年度第 1 四半期	
適格流動資産（1）					
1	適格流動資産の合計額	15,253,517		15,102,670	
資金流出額（2）		資金流出率を乗じる前の額	資金流出率を乗じた後の額	資金流出率を乗じる前の額	資金流出率を乗じた後の額
2	リテール無担保資金調達に係る資金流出額	17,598,051	821,710	17,505,700	816,115
3	うち、安定預金の額	695,051	20,851	675,158	20,254
4	うち、準安定預金の額	7,967,894	800,859	7,916,048	795,861
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	13,048,448	9,285,773	13,355,983	9,497,555
6	うち、適格オペレーショナル預金の額	0	0	0	0
7	うち、適格オペレーショナル預金、負債性有価証券以外のホールセール無担保資金調達に係る資金の額	10,556,654	6,793,979	10,883,394	7,024,966
8	うち、負債性有価証券の額	2,491,794	2,491,794	2,472,589	2,472,589
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		188,060		114,991
10	デリバティブ取引等、資金調達プログラム、与信・流動性ファシリティに係る資金流出額	4,698,736	1,157,455	4,883,352	1,172,476
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	328,575	328,575	315,657	315,657
12	うち、資金調達プログラムに係る資金流出額	0	0	0	0
13	うち、与信・流動性ファシリティに係る資金流出額	4,370,161	828,880	4,567,695	856,819
14	資金提供義務等に基づく資金流出額	357,062	233,949	312,805	205,822
15	偶発事象に係る資金流出額	12,710,688	24,321	12,718,359	24,910
16	資金流出合計額		11,711,268		11,831,869
資金流入額（3）		資金流入率を乗じる前の額	資金流入率を乗じた後の額	資金流入率を乗じる前の額	資金流入率を乗じた後の額
17	有担保資金運用等に係る資金流入額	69,457	0	81,355	0
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	3,034,097	2,243,960	2,983,481	2,236,414
19	その他資金流入額	437,720	277,969	311,039	222,835
20	資金流入合計額	3,541,274	2,521,929	3,375,875	2,459,249
単体流動性カバレッジ比率（4）					
21	算入可能適格流動資産の合計額		15,253,517		15,102,670
22	純資金流出額		9,189,339		9,372,620
23	単体流動性カバレッジ比率		165.9		161.1
24	平均値計算用データ数	62		59	

単体流動性カバレッジ比率に関する定性的開示事項

(1) 時系列における単体流動性カバレッジ比率の変動に関する事項

当社における過去2年間の流動性カバレッジ比率は、概ね安定的に推移しております。

(2) 単体流動性カバレッジ比率の水準の評価に関する事項

当社単体の流動性カバレッジ比率は所要水準を十分に満たしており、今後も現在の水準から大きくかい離することは想定しておりません。

また、実績値は当初の見通しと大きく異なっておりません。

(3) 算入可能適格流動資産の合計額の内容に関する事項

算入可能適格流動資産は中央銀行への預け金、国債等が大半を占めております。通貨または種類等の構成や所在地に著しい変動は発生しておりません。また、主要な通貨において、算入可能適格流動資産の合計額と純資金流出額の間に著しい通貨のミスマッチは発生しておりません。

(4) その他単体流動性カバレッジ比率に関する事項

当社は、「適格オペレーショナル預金に係る特例」および「シナリオ法による時価変動時所要追加担保額」を適用しておりません。

【正】

（単位：百万円、%、件）

項目		2019年度第2四半期		2019年度第1四半期	
適格流動資産（1）					
1	適格流動資産の合計額		15,251,414		15,100,550
資金流出額（2）		資金流出率を乗じる前の額	資金流出率を乗じた後の額	資金流出率を乗じる前の額	資金流出率を乗じた後の額
2	リテール無担保資金調達に係る資金流出額	17,598,051	821,710	17,505,609	816,088
3	うち、安定預金の額	695,051	20,851	675,158	20,254
4	うち、準安定預金の額	7,967,894	800,859	7,915,957	795,833
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	13,048,448	10,524,442	13,356,073	11,201,311
6	うち、適格オペレーショナル預金の額	0	0	0	0
7	うち、適格オペレーショナル預金、負債性有価証券以外のホールセール無担保資金調達に係る資金の額	10,556,654	8,032,648	10,883,484	8,728,722
8	うち、負債性有価証券の額	2,491,794	2,491,794	2,472,589	2,472,589
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		188,060		114,991
10	デリバティブ取引等、資金調達プログラム、与信・流動性ファシリティに係る資金流出額	4,698,736	1,547,515	4,883,352	1,562,536
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	328,575	328,575	315,657	315,657
12	うち、資金調達プログラムに係る資金流出額	0	0	0	0
13	うち、与信・流動性ファシリティに係る資金流出額	4,370,161	1,218,940	4,567,695	1,246,879
14	資金提供義務等に基づく資金流出額	357,062	233,949	312,805	205,822
15	偶発事象に係る資金流出額	12,710,688	24,321	12,718,359	24,910
16	資金流出合計額		13,339,997		13,925,658
資金流入額（3）		資金流入率を乗じる前の額	資金流入率を乗じた後の額	資金流入率を乗じる前の額	資金流入率を乗じた後の額
17	有担保資金運用等に係る資金流入額	69,457	0	81,355	0
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	3,034,097	2,278,670	2,983,480	2,314,467
19	その他資金流入額	437,720	277,969	311,039	222,835
20	資金流入合計額	3,541,274	2,556,639	3,375,874	2,537,302
単体流動性カバレッジ比率（4）					
21	算入可能適格流動資産の合計額		15,251,414		15,100,550
22	純資金流出額		10,783,358		11,388,356
23	単体流動性カバレッジ比率		141.4		132.5
24	平均値計算用データ数		62		59

（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。

単体流動性カバレッジ比率に関する定性的開示事項

(1) 時系列における単体流動性カバレッジ比率の変動に関する事項

当社における過去2年間の流動性カバレッジ比率は、概ね安定的に推移しております。

(2) 単体流動性カバレッジ比率の水準の評価に関する事項

当社単体の流動性カバレッジ比率は所要水準を十分に満たしており、今後も現在の水準から大きくかい離することは想定しておりません。また、実績値は当初の見通しと大きく異なっておりません。

(3) 算入可能適格流動資産の合計額の内容に関する事項

算入可能適格流動資産は中央銀行への預け金、国債等が大半を占めております。通貨または種類等の構成や所在地に著しい変動は発生しておりません。また、主要な通貨において、算入可能適格流動資産の合計額と純資金流出額の間に著しい通貨のミスマッチは発生しておりません。

(4) その他単体流動性カバレッジ比率に関する事項

当社は、「適格オペレーショナル預金に係る特例」および「シナリオ法による時価変動時所要追加担保額」を適用しておりません。

以　上