

2022年11月11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、下記の通り訂正させていただきます。

2020年2月13日付「流動性カバレッジ比率の訂正」(※)以降、データ、システム、算定手順の点検・見直しなどに取り組んでまいりました。今回、これら対応が完了し、新たに算定された結果を踏まえ、過去算出した数値の訂正をお知らせするものです。訂正対象の期間は、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、2020年度第2四半期から2021年度第4四半期としております。

なお訂正後においても、当グループ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。

(※) <https://www.smth.jp/-/media/th/news/updates/2020/200213.pdf>

記

1. 概要

各期における算入可能適格流動性資産の合計額および純資金流出額を訂正しております。

2. 訂正対象

(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) 2022 ディスクロージャー誌 資料編 (ii) 2021 中間期ディスクロージャー誌 (iii) 2022 Annual Report -Financial Data Section- (iv) 2021 Interim Report
------	---

(2) バーゼルⅢ関連データ

対象資料	2021年度第2四半期から2021年度第4四半期における (i) 主要な指標(流動性比率の推移) (ii) 流動性カバレッジ比率
------	--

(3) IR資料

対象資料	2021年度第2四半期から2021年度第4四半期における (i) 決算説明会資料 (ii) 決算の概要
------	---

上記(1)～(3)の資料に応じて訂正後または訂正前後の資料を当グループのウェブサイトにて掲載しております。なお、2022年度第1四半期の開示数値に訂正はありませんが、上記数値の訂正影響により、過去数値等の訂正を行っております。

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)

【訂正後】	2021年度 第4四半期	2021年度 第3四半期	2021年度 第2四半期	2021年度 第1四半期	2020年度 第4四半期	2020年度 第3四半期	2020年度 第2四半期
(単位: 百万円、%)							
算入可能適格流動性資産の合計額	17,729,217	18,165,813	18,094,605	17,569,667	17,325,947	17,490,643	17,302,937
純資金流出額	11,018,789	9,154,671	10,188,241	10,248,542	11,272,413	10,298,706	11,349,629
連結流動性カバレッジ比率	160.8%	198.4%	177.6%	171.4%	153.7%	169.8%	152.4%

(注) 上記のうち、2021年度第3四半期以前の期間は、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、算出をしております(保持データ等の制約ある中、対象期間はディスクロージャー誌の備置期間に限定)

【訂正前】	2021年度 第4四半期	2021年度 第3四半期	2021年度 第2四半期	2021年度 第1四半期	2020年度 第4四半期	2020年度 第3四半期	2020年度 第2四半期
(単位: 百万円、%)							
算入可能適格流動性資産の合計額	19,203,403	18,647,224	18,861,288	18,228,161	18,052,471	18,053,546	17,953,290
純資金流出額	11,069,161	8,415,323	9,636,918	9,640,248	10,841,449	9,695,429	10,968,739
連結流動性カバレッジ比率	173.4%	221.5%	195.7%	189.0%	166.5%	186.2%	163.6%

(2) 三井住友信託銀行株式会社(連結)

【訂正後】	2021年度 第4四半期	2021年度 第3四半期	2021年度 第2四半期	2021年度 第1四半期	2020年度 第4四半期	2020年度 第3四半期	2020年度 第2四半期
(単位: 百万円、%)							
算入可能適格流動性資産の合計額	17,729,217	18,165,813	18,094,605	17,569,667	17,325,947	17,490,643	17,302,937
純資金流出額	11,085,943	9,190,484	10,242,079	10,328,749	11,351,363	10,398,870	11,382,827
連結流動性カバレッジ比率	159.9%	197.6%	176.6%	170.1%	152.6%	168.1%	152.0%

(注) 上記のうち、2021年度第3四半期以前の期間は、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、算出をしております(保持データ等の制約ある中、対象期間はディスクロージャー誌の備置期間に限定)

【訂正前】	2021年度 第4四半期	2021年度 第3四半期	2021年度 第2四半期	2021年度 第1四半期	2020年度 第4四半期	2020年度 第3四半期	2020年度 第2四半期
(単位: 百万円、%)							
算入可能適格流動性資産の合計額	19,203,403	18,647,224	18,861,288	18,228,161	18,052,471	18,053,546	17,953,290
純資金流出額	11,104,073	8,451,472	9,690,946	9,720,773	10,920,820	9,795,823	11,002,119
連結流動性カバレッジ比率	172.9%	220.6%	194.6%	187.5%	165.3%	184.2%	163.1%

(3) 三井住友信託銀行株式会社(単体)

【訂正後】	2021年度 第4四半期	2021年度 第3四半期	2021年度 第2四半期	2021年度 第1四半期	2020年度 第4四半期	2020年度 第3四半期	2020年度 第2四半期
(単位: 百万円、%)							
算入可能適格流動性資産の合計額	17,487,539	17,911,071	17,850,810	17,335,771	17,098,215	17,269,415	17,010,664
純資金流出額	10,583,950	8,216,422	9,310,339	9,370,200	10,513,519	9,634,913	10,553,092
単体流動性カバレッジ比率	165.2%	217.9%	191.7%	185.0%	162.6%	179.2%	161.1%

(注) 上記のうち、2021年度第3四半期以前の期間は、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、算出をしております(保持データ等の制約ある中、対象期間はディスクロージャー誌の備置期間に限定)

【訂正前】	2021年度 第4四半期	2021年度 第3四半期	2021年度 第2四半期	2021年度 第1四半期	2020年度 第4四半期	2020年度 第3四半期	2020年度 第2四半期
(単位: 百万円、%)							
算入可能適格流動性資産の合計額	18,957,174	18,392,482	18,617,493	17,994,265	17,824,739	17,832,318	17,661,017
純資金流出額	10,155,805	7,412,781	8,728,516	8,716,289	9,993,155	8,974,008	10,139,836
単体流動性カバレッジ比率	186.6%	248.1%	213.2%	206.4%	178.3%	198.7%	174.1%