

証券化商品等への投融資等の状況（三井住友フィナンシャルグループ連結）

以下の計数は、平成21年度中間期末の管理会計ベースであります。また、格付けに関する情報は、平成21年度中間期末時点におけるものであります。

I 証券化商品等の状況

平成21年度中間期末の当社グループが保有する証券化商品等（除く米国政府支援機関保証債等、以下同じ）の償却・引当控除後の残高は、サブプライムローン関連で1億円、サブプライムローン関連以外で310億円であります。平成21年度中間期における証

券化商品等に係る損失処理額は、サブプライムローン関連で1億円であります。サブプライムローン関連以外の損失処理額はありません。

◆サブプライムローン関連

（単位：億円）

	平成21年度中間期末				平成20年度末				裏付資産の格付け等
	残高 (償却・引当 控除後)	平成20年度 末比	うち海外	平成20年度 末比	含み 損益 (償却後)	平成20年度 末比	残高 (償却・引当 控除後)	うち海外	含み 損益 (償却後)
証券化商品	1	△2	1	△2	—	—	3	3	—
サブプライムローン関連 合計	1	△2	1	△2	—	—	3	3	—

◆サブプライムローン関連以外（除く米国政府支援機関保証債等）

（単位：億円）

	平成21年度中間期末				平成20年度末				裏付資産の格付け等
	残高 (償却・引当 控除後)	平成20年度 末比	うち海外	平成20年度 末比	含み 損益 (償却後)	平成20年度 末比	残高 (償却・引当 控除後)	うち海外	含み 損益 (償却後)
クレジットカード債権を裏付資産とする証券化商品（Cards）	—	△41	—	△41	—	4	41	41	△4
事業法人向けローン債権を裏付資産とする証券化商品（CLO）	32	△19	32	△19	0	11	51	51	△11
シニア部分	31	△19	31	△19	△3	8	50	50	△11
エクイティ部分	1	△0	1	△0	3	3	1	1	—
商業用不動産を裏付資産とする証券化商品（CMBS）	202	△6	—	—	△4	△2	208	—	△2
証券化商品	234	△66	32	△60	△4	13	300	92	△17
ウェアハウジングローン等	76	10	76	10	—	—	66	66	—
サブプライムローン関連以外 合計	310	△56	108	△50	△4	13	366	158	△17

- （注）1. シニア部分は、トランピング（優先劣後構造を設けること）の上位部分であります。
2. ウェアハウジングローンは、証券化目的の特別目的会社に対し、同社が保有する証券化商品を担保に行う融資業務であります。
3. 格付けは、原則としてスタンダード&プアーズ社とムーディーズ社のいずれか低い方を採用し、スタンダード&プアーズ社の表記方法で表示しております。
4. RMBS（除く米国政府支援機関保証債等）とABCPの保有残高はありません。
5. 上記には、米国政府支援機関保証債等（下記参考1をご参照）及び三井住友銀行が貸出債権の流動化において保有する劣後受益権（次ページ参考2をご参照）は含めておりません。

<参考1>米国政府支援機関保証債等

（単位：億円）

	平成21年度中間期末				平成20年度末				格付け等
	残高	平成20年度 末比	うち海外	平成20年度 末比	含み 損益	平成20年度 末比	残高	うち海外	含み 損益
米国政府支援機関保証債等	540	△2,212	540	△2,212	△4	△35	2,752	2,752	31

- （注）1. 米国政府支援機関保証債等とは、ジニーメイ、ファニーメイ、フレディマックが発行している住宅ローン債権を裏付資産とする債券であります。これ以外に米国政府支援機関（ファニーメイ、フレディマック、フェデラルホームローンバンク）が発行する債券（裏付資産なし）1,834億円を保有しております。
2. 格付けは、原則としてスタンダード&プアーズ社とムーディーズ社のいずれか低い方を採用し、スタンダード&プアーズ社の表記方法で表示しております。
3. 平成21年度中間期における米国政府支援機関保証債等に係る売却損益は、+29億円であります。

＜参考2＞三井住友銀行が貸出債権の流動化において保有する劣後受益権

(単位：億円)

	平成21年度中間期末					平成20年度末			
	残高	平成20年度末比	うち海外	うちサブプライム関連	貸倒引当金	残高	うち海外	うちサブプライム関連	貸倒引当金
住宅ローン債権	2,531	23	—	—	—	2,508	—	—	—
事業法人向け貸付債権	69	△2	—	—	27	71	—	—	15
合計	2,600	21	—	—	27	2,579	—	—	15

(注) 1. 三井住友銀行以外の連結子会社における保有はありません。
2. 貸倒引当金には正常先に対する一般貸倒引当金を含めておりません。

II モノライン保険会社との取引の状況

モノライン保険会社を取引相手とするクレジットデリバティブ取引（CDS）

(単位：億円)

	平成21年度中間期末			平成20年度末		参照債権残高	平成20年度末比	参照債権残高
	与信額	平成20年度末比	貸倒引当金	与信額	貸倒引当金			
モノライン保険会社を取引相手とするCDSのエクスポージャー	422	△898	19	1,320	50	4,878	△489	5,367

モノライン保険会社保証付の投融資等

(単位：億円)

	平成21年度中間期末			平成20年度末	
	残高	平成20年度末比	貸倒引当金	残高	貸倒引当金
モノライン保険会社保証付の投融資等	147	24	0	123	0

(参考) 上記のほか、モノライン保険会社をグループの一部に持つ保険会社への融資枠等が7億円(全額引出)あります。

III レバレッジド・ローンの状況

(単位：億円)

	平成21年度中間期末					平成20年度末		
	貸出金	平成20年度末比	コミットメントライン未引出額	平成20年度末比	貸倒引当金	貸出金	コミットメントライン未引出額	貸倒引当金
欧州向け	2,961	△99	328	△14	19	3,060	342	28
日本向け	1,773	△26	83	△209	141	1,799	292	134
米州向け	1,337	△453	642	△58	31	1,790	700	41
アジア向け	800	12	52	13	1	788	39	23
合計	6,871	△566	1,105	△268	192	7,437	1,373	226

(注) 1. 上記貸出金残高のうち売却予定額は約100億円であります。なお、平成21年度中間期の売却元本は約200億円、売却損益は約△70億円であります。
2. 「I 証券化商品等の状況」の裏付資産に含まれるレバレッジド・ローンは、上記に含めておりません。
3. 貸倒引当金には正常先に対する一般貸倒引当金を含めておりません。

IV ABCP スポンサー業務の状況

(単位：億円)

原資産別内訳	平成21年度中間期末					平成20年度末			プログラムの内容	
	原資産残高	平成20年度末比	うち海外	平成20年度末比	貸倒引当金	原資産残高	うち海外	貸倒引当金	流動性補完	信用補完
事業法人向け債権	3,902	△2,697	1,631	△492	—	6,599	2,123	—	あり	あり
金融機関向け債権	181	△16	181	△16	—	197	197	—	あり	あり
消費者向け債権	205	△79	205	△79	—	284	284	—	あり	あり
その他	2	△4	2	△4	—	6	6	—	あり	あり
合計	4,290	△2,796	2,019	△591	—	7,086	2,610	—		

(注) 貸倒引当金には正常先に対する一般貸倒引当金を含めておりません。
(参考) 上記のほか、他社がスポンサーとなるABCPプログラムに対し、当社グループが流動性補完を行っているものがあり、当該プログラムに係る流動性補完枠は約510億円あります。

V その他

当社グループは、いわゆるSIV(Structured Investment Vehicle)の発行する有価証券を保有しておりません。