

## 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23年度中間期末の管理会計ベースであります。

### I 証券化商品の状況

(単位：億円)

	平成23年度中間期末						平成22年度末		
	残高 (償却・引当 控除後)	平成22年度 末比	うち海外	平成22年度 末比	含み 損益 (償却後)	平成22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)	23	△3	23	△3	△0	1	26	26	△1
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)	8	△7	8	△7	11	△1	15	15	12
商業用不動産を裏付資産とする 証券化商品(CMBS)	189	62	69	69	6	5	127	—	1
住宅ローン債権を裏付資産とする 証券化商品(RMBS等)	1	0	1	0	1	△2	1	1	3
合計	221	52	101	59	18	3	169	42	15

- (注) 1. サブプライムローン関連の残高は約1億円であります。  
 2. ABCPの保有残高はありません。  
 3. 米国政府支援機関保証債、住宅金融支援機構債、並びに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等は含めておりません。  
 4. 平成23年度中間期における損失処理額はあります。

### 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23年度中間期末			平成22年度末		平成23年度中間期末		平成22年度末
	与信額	平成22年度 末比	貸倒 引当金	与信額	貸倒 引当金	参照債権 残高	平成22年度 末比	参照債権 残高
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	93	64	30	29	8	2,959	△254	3,213

- (注) 1. 参照債権は投資適格ランクで、サブプライムローン関連のものは含まれておりません。  
 2. 平成23年度中間期における損失処理額は約22億円あります。

#### モノライン保険会社保証付の投融資等

(単位：億円)

	平成23年度中間期末			平成22年度末	
	残高	平成22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	83	△11	0	94	0

- (注) 原債権は投資適格ランクのプロジェクトファイナンス等で、サブプライムローン関連のものは含まれておりません。

## III レバレッジド・ローンの状況

(単位：億円)

	平成23年度中間期末				貸倒引当金	平成22年度末		
	貸出金残高	平成22年度末比	コミットメントライン未引出額	平成22年度末比		貸出金残高	コミットメントライン未引出額	貸倒引当金
欧州向け	1,411	△558	180	△54	50	1,969	234	75
日本向け	897	△938	138	△17	28	1,835	155	127
米州向け	767	△5	525	△136	75	772	661	110
アジア向け	586	△68	52	△25	—	654	77	10
合計	3,661	△1,569	895	△232	153	5,230	1,127	322

- (注) 1. 貸出金残高のうち、売却予定額は約40億円であります。なお、平成23年度中間期の売却元本は約70億円、売却損益は約△20億円であります。  
 2. 「I 証券化商品の状況」の裏付資産に含まれるレバレッジド・ローンは、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は含めておりません。

## IV ABCPスポンサー業務の状況

当社グループは、顧客の資金調達のため、当該顧客の売掛債権等を原資産としたABCPの発行に関するスポンサー業務を行っております。原資産残高の大部分は事業法人向け債権であり、サブプライムローン関連の資産は含まれておりません。

(単位：億円)

	平成23年度中間期末				平成22年度末	
	残高	平成22年度末比	うち海外	平成22年度末比	残高	うち海外
ABCPスポンサー業務に係る原資産	4,209	△523	1,785	△162	4,732	1,947

(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率は約400億円であります。

## 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。