

## 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24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24年度中間期末						平成23年度末		
	残高 (償却・引 当控除後)	平成23年 度末比	うち海外	平成23年 度末比	含み 損益 (償却後)	平成23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等を裏付資産とする 証券化商品(Cards等)	805	311	805	311	4	1	494	494	2
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)	5	△2	5	△2	14	△1	7	7	15
商業用不動産を裏付資産とする 証券化商品(CMBS)	120	△74	70	△4	5	△1	194	74	6
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	△0	1	1	1
合計	931	235	881	305	23	△1	696	576	24

(注) 1. ABCPの保有残高はありません。

2. 米国政府支援機関保証債、住宅金融支援機構債、並びに自行債権の流動化に伴い保有する劣後受益権等は含めておりません。

### II モノライン保険会社との取引の状況(クレジットデリバティブ取引)

(単位：億円)

	平成24年度中間期末				平成23年度末	
	与信額	平成23年 度末比	参照債権 残高	平成23年 度末比	与信額	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	19	△11	1,546	△815	30	2,361

### III レバレッジローンの状況

(単位：億円)

	平成24年度中間期末				平成23年度末	
	貸出金 残高	平成23年 度末比	コミットメント ライン 未引出額	平成23年 度末比	貸出金 残高	コミットメント ライン 未引出額
欧州向け	1,138	△374	173	△33	1,512	207
日本向け	1,832	522	231	9	1,310	223
米州向け	586	△169	591	80	756	511
アジア向け	561	△59	53	△4	620	57
合計	4,118	△80	1,049	51	4,198	998

### 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ます。

(単位：億円)

	平成24年度中間期末				平成23年度末	
	残高	平成23年 度末比	うち海外	平成23年 度末比	残高	うち海外
ABCPスポンサー業務に係る原資産	4,612	△1,387	2,092	△217	5,999	2,309

(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434億円であります。

### 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。