

(ご参考②) 証券化商品等への投融資等の状況

1. 証券化商品等の状況

管理会計ベース

【連結】

	23年3月末						22年3月末		
	残高 (償却・ 引当 控除後)	22年 3月末比	うち海外	22年 3月末比	含み 損益 (償却後)	22年 3月末比	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)	26	26	26	26	△ 1	△ 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)	15	△ 14	15	△ 14	12	7	29	29	5
商業用不動産を裏付資産とする証券化商品 (CMBS)	127	△ 9	—	—	1	1	136	—	0
住宅ローン債権を裏付資産とする証券化商品 (RMBS等)	13	12	1	△ 0	3	3	1	1	0
合計	181	15	42	12	15	10	166	30	5

(注) 1. RMBS等のうち、サブプライムローン関連の残高は約1億円。

2. ABCPの保有残高はない。

3. 上記には、米国政府支援機関保証債等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は含めていない。

4. 平成22年度における損失処理額はない。

2. モノライン保険会社との取引の状況

(1) 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)

【連結】

	23年3月末			22年3月末		23年3月末		22年3月末	
	与信額	22年 3月末比	貸 倒 引当金	与信額	貸 倒 引当金	参照債権 残高	22年 3月末比	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	29	△ 456	8	485	136	3,213	△ 1,818	5,031	

(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いない。

2. 平成22年度における損失処理額は約37億円。

(2) モノライン保険会社保証付の投融資等

【連結】

	23年3月末			22年3月末	
	残高	22年 3月末比	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	94	△ 1	0	95	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いない。

3. レバレッジド・ローンの状況

【連結】		23年3月末					22年3月末		
		貸出金	22年 3月末比	コミットメント ライン 未引出額	22年 3月末比	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	1,969	△ 642	234	△ 54	75	2,611	288	62	
日 本 向 け	1,835	73	155	37	127	1,762	118	127	
米 州 向 け	772	△ 360	661	△ 74	110	1,132	735	122	
ア ジ ア 向 け	654	58	77	△ 17	10	596	94	23	
合 計	5,230	△ 871	1,127	△ 108	322	6,101	1,235	334	

(注) 1. 上記貸出金残高のうち売却予定額は約30億円。

なお、平成22年度における売却元本は約240億円、売却損益は約▲30億円。

2. 「1. 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、上記に含めていない。
3. 引当金には正常先に対する一般貸倒引当金を含めていない。

4. A B C P 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A B C Pの発行に関するスポンサー業務を行っている。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いない。

	23年3月末				22年3月末	
	残高	22年 3月末比	うち海外	22年 3月末比	残高	うち海外
A B C P スポンサー業務に 係る原資産	4,732	△ 281	1,947	561	5,013	1,386

(参考) 上記の他、他社がスポンサーとなるA B C P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470億円。

5. その他

当社グループは、いわゆるS I V (Structured Investment Vehicle) の発行する有価証券を保有していない。