

2008年6月13日

三井住友海上メットライフ生命保険株式会社

証券化商品等への投資及びサブプライム関連投資の状況

三井住友海上メットライフ生命保険株式会社（本社：東京都中央区、取締役社長：栗岡 威）は、金融安定化フォーラム（FSF）の報告書に示された先進的開示例に基づき、平成20年3月末時点の証券化商品等への投資及びサブプライム関連投資の状況についてご報告いたします。

【投資状況】

1. 特別目的事業体（SPEs）一般 （単位：億円）

	時価	含み損益	実現損益
特別目的事業体（SPEs）一般	-	-	-

2. 債務担保証券（CDO）一般 （単位：億円）

	時価	含み損益	実現損益
債務担保証券（CDO）	-	-	-

3. その他のサブプライム・Alt-A エクスポージャー （単位：億円）

	時価	含み損益	実現損益
その他のサブプライム・Alt-A エクスポージャー	-	-	-

4. 商業用不動産担保証券（CMBS） （単位：億円）

	格付	時価		含み損益	実現損益
			参考:平成19年3月末		
商業用不動産担保証券（CMBS）		215.0	206.5	-	△44.6
日本		-	-	-	-
米国		208.1	198.8	-	△43.8
AAA		207.3	197.6	-	△43.4
AA		0.8	1.1	-	△0.3
A		-	-	-	-
BBB以下		-	-	-	-
欧州		-	-	-	-
豪州		7.0	7.7	-	△0.8
AAA		7.0	7.7	-	△0.8
AA		-	-	-	-
A		-	-	-	-
BBB以下		-	-	-	-
その他		-	-	-	-

- 裏付資産は米国及び豪州の商業用不動産（オフィス、商業施設、倉庫、賃貸住宅、ホテル等）です。
- 上記は売買目的有価証券に区分しているため、評価損益はすべて実現損益に含まれますので、含み損益はありません。なお、上記の実現損益のうち、当年度の現地通貨ベースでの評価損益は△4.0億円、為替の変動に係る評

価損益は△40.4億円です。(当該資産は外貨建て定期年金保険に対応する運用資産の一部であり、ALM上、資産側と負債側の通貨をマッチングさせていることから為替に係る評価損益は相殺される構造となっており、当年度損益への大きな影響はありません。)

5. レバレッジド・ファイナンス

(単位：億円)

	時価		含み損益	実現損益
		参考：平成19年3月末		
レバレッジド・ファイナンス	—	—	—	—

6. その他

(単位：億円)

	格付	時価		含み損益	実現損益
			参考：平成19年3月		
その他		135.6	96.5	—	△22.0
US ABS (カードローン・自動車ローン担保等)		135.6	96.5	—	△22.0
	AAA	134.1	94.7	—	△21.7
	AA	—	—	—	—
	A	1.5	1.7	—	△0.3
	BBB以下	—	—	—	—

- ・ サブプライムローン関連のエクスポージャーはございません。
- ・ 上記は売買目的有価証券に区分しているため、評価損益はすべて実現損益に含まれますので、含み損益はありません。なお、上記の実現損益のうち、当年度の現地通貨ベースでの評価損益は2.6億円、為替の変動に係る評価損益は△24.7億円です。(当該資産は外貨建て定期年金保険に対応する運用資産の一部であり、ALM上、資産側と負債側の通貨をマッチングさせていることから為替に係る評価損益は相殺される構造となっており、当年度損益への大きな影響はありません。)

※上記の時価の金額は、当社の貸借対照表上の「金銭の信託」に含まれている金額です。

※上記の実現損益の金額は、当社の損益計算書上の「金銭の信託運用損」に含まれている金額です。

※投資信託については開示対象から除いております。