

2008年5月23日

ソニーフィナンシャルホールディングス株式会社

コード番号：8729 東証第一部

ソニー生命の証券化商品等への投資の状況に関するお知らせ

ソニーフィナンシャルホールディングス株式会社（社長：徳中 暉久／本社 東京都港区）の100%子会社、ソニー生命保険株式会社（社長：於久田 太郎／本社 東京都港区）は本日、「証券化商品等への投資の状況について」を公表しておりますので以下にお知らせいたします。

なお、ソニーフィナンシャルホールディングスグループにおいて、サブプライムに関連する投資はございません。

記

<添付書類>

「証券化商品等への投資の状況について」リリース資料 一式

以 上

（お問い合わせ先）

ソニーフィナンシャルホールディングス株式会社

広報・IR部 此尾・高橋 電話 (03) 5785-1074

（ソニーフィナンシャルホールディングス株式会社のホームページ） <http://www.sonyfh.co.jp/>

証券化商品等への投資の状況について

ソニー生命保険株式会社(社長: 於久田太郎)は、4月7日(月)付の金融安定化フォーラム(FSF)のガイドラインを踏まえ、平成20年3月末時点での当社が保有する証券化商品等への投資の状況につきまして、添付別紙のとおりご報告いたします。

なお、サブプライム関連投資はございません。

以上

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	—	—	—
ABCP	—	—	—
うち当社が組成するSPEs	—	—	—
SIV	—	—	—
うち当社が組成するSPEs	—	—	—
その他	—	—	—
うち当社が組成するSPEs	—	—	—

②債務担保証券 (CDO)

(単位:億円)

	時価	含み損益	実現損益
債務担保証券 (CDO)	—	—	—
ABS—	—	—	—
CDO	—	—	—
シニア	—	—	—
うちサブプライム・Alt-Aエクスポージャー	—	—	—
メザニン	—	—	—
うちサブプライム・Alt-Aエクスポージャー	—	—	—
エクイティ	—	—	—
うちサブプライム・Alt-Aエクスポージャー	—	—	—
CLO	—	—	—
シニア	—	—	—
メザニン	—	—	—
エクイティ	—	—	—
CBO	—	—	—
シニア	—	—	—
メザニン	—	—	—
エクイティ	—	—	—
その他	—	—	—
シニア	—	—	—
メザニン	—	—	—
エクイティ	—	—	—

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	—	—	—
証券化されていないローン	—	—	—
RMBS	—	—	—
デリバティブ	—	—	—
コミットメントライン	—	—	—
その他	—	—	—

④商業用不動産担保証券(CMBS)

(単位:億円)

	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)	—	—	—	—
日本	—	—	—	—
米国	—	—	—	—
欧州	—	—	—	—
英国	—	—	—	—
その他	—	—	—	—

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	—	—	—	—
通信	—	—	—	—
電気	—	—	—	—
娯楽	—	—	—	—
サービス	—	—	—	—
その他	—	—	—	—

⑥その他

「CBリパッケージ債 3月末時点 時価185億円 含み損3億円」と「元本確保型クーポン日経平均連動30年債 3月末時点 時価449億円 含み損100億円」となっております。

※なお、上記数値につきましては5月16日付公表の「平成19年度決算(案)のお知らせ」内の有価証券の評価損益に含まれております。

<用語説明>

ABCP : 資産担保コマーシャルペーパー

ABS : 資産担保証券

ABS-CDO : ABSを裏付資産とした債務担保証券

A1 to A : 米国の住宅ローンのうち、「プライムローン (信用度の高い借手向けのローン)」と「サブプライム・ローン (信用度の低い借手向けのローン) の間に位置する中間部分

CBO : 債券担保証券

CLO : ローン担保証券

RMBS : 住宅ローン担保証券

レバレッジド・ファイナンス : 企業の買収・合併の際に提供される、主に被買収企業のキャッシュフローに依拠したファイナンス

以上