

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

平成24年度第3四半期報告について、金融安定化フォーラムの報告書(平成20年4月)に示された先進的開示例に基づき、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を開示します。概要は以下のとおりです。

【サブプライムローン】

- ・ サブプライムローン関連商品への直接投資はありません。
- ・ ヘッジファンドを通じたサブプライムローン関連商品への間接的なエクスポージャーは1億円未満です。

【証券化商品等】

- ・ 平成24年度第3四半期末のエクスポージャーはすべて日本国内のものであり、海外のものはありません。

1. 投資状況

①特別目的事業体(SPEs)一般

特別目的事業体(SPEs)への投資はありません。

②債務担保証券(CDO)

債務担保証券(CDO)への投資はありません。

③その他のサブプライム・Alt-A エクスポージャー

サブプライム・Alt-A エクスポージャーを裏付資産とした証券化商品等の取引・残高はありません。

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24年9月末		
商業用不動産担保証券(CMBS)	59	59	△0	△39
日本	59	59	△0	△39

※ 担保となる不動産はすべてオフィスビルとなっています。

⑤レバレッジド・ファイナンス

レバレッジド・ファイナンスの取引・残高はありません。

⑥その他(※1)

(単位：億円)

	時価	含み損益	実現損益
RMBS(※2)	10,714	399	-
うち住宅金融支援機構	7,715	243	-
うち民間金融機関等	2,999	156	-
ABS(※3)	148	1	-
クレジットリンクノート(※4)	50	0	-

※1. サブプライムローンに直接投資しているものではありません。

なお、当社が保有しているヘッジファンドを通じたサブプライムローン関連商品への間接的なエクスポージャーは1億円未満です。

※2. RMBSの裏付債権はすべて日本国内の住宅ローンであり、海外の住宅ローンを裏付けとするものではありません。

※3. ABSの裏付資産はすべて日本国内の売掛債権、リース料債権等であり、海外の債権を裏付けとするものではありません。

※4. クレジットリンクノートに内包されるクレジットデリバティブは、すべて日本国内の企業を参照するものです。

①～⑥総合計

(単位：億円)

	時価	含み損益	実現損益
証券化商品等合計	10,973	400	△ 39

※ 上記残高のエクスポージャーはすべて日本国内のものであり、海外のものはありません。

2. その他の関連情報

子会社等における、サブプライムローン関連商品への投資はありません。

<各種証券化商品の用語について>

ABS: Asset Backed Securities (資産担保証券)

ABS-CDO: CDO of ABS (資産担保証券を裏付資産とする債務担保証券)

CBO: Collateralized Bond Obligation (債券担保証券)

CDO: Collateralized Debt Obligation (債務担保証券)

CDS: Credit Default Swap (クレジット・デフォルト・スワップ)

CMBS: Commercial Mortgage-Backed Securities (商業用不動産担保証券)

CLO: Collateralized Loan Obligation (ローン担保証券)

RMBS: Residential Mortgage-Backed Securities (住宅ローン担保証券)

以上