

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25年度決算について、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25年度末のエクスポージャーは大半が日本国内のもので、海外のものはすべて米国政府系機関の保証がついています。

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)

商業用不動産担保証券(CMBS)への投資はありません。

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
国内RMBS	11,010	448	-
うち住宅金融支援機構	8,458	308	-
うち民間金融機関等	2,552	140	-
米国RMBS(※2)	2,428	28	△ 18
ABS(※3)	464	0	0
クレジットリンクノート(※4)	61	1	-

※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. 米国RMBSはすべて米国政府系機関の保証がついています。

※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	13,964	479	△ 18

2. その他の関連情報

子会社における、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)

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

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

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

以上