

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 22 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約 1 億円です。

【証券化商品等】

- ・ 平成 22 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22年9月末		
商業用不動産担保証券(CMBS)	110	158	△ 5	△ 4
日本	110	158	△ 5	△ 4

※ 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。

※ 実現損益はすべて売却損となっています。

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)	8,823	323	-
うち住宅金融支援機構	5,327	177	-
うち民間金融機関等	3,495	146	-
ABS(※3)	714	4	-

※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約1億円です。

CDS、クレジットリンクノートの取引・残高はありません。

※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。

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	9,648	323	△4

※ 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