

【参考-2】証券化商品等の投資及びサブプライム関連投資の状況

平成20年12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、下記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。

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	-	-	-
ABC P	-	-	-
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	-	-	-

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	-	-	-

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	-	-	-

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20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	-	-	-	-

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20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	-	-	-	-

その他

「Cブリパッケージ債 12月末時点 時価196億円 含み損12億円」と「元本確保型クーポン日経平均連動30年債 12月末時点 時価418億円 含み益4億円」となっております。

なお、上記数値につきましては「平成20年度第3四半期報告」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

Alt-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