

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

1. 特別目的事業体（SPE s）

（単位：億円）

	時価	含み損益	実現損益
特別目的事業体（SPE s）	—	—	—
ABCP	—	—	—
SIV	—	—	—
その他	—	—	—

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）	—	—	—
CDO（メザニン）	—	—	—
うちサブプライム関連	—	—	—
CLO	—	—	—
CBO	—	—	—
その他	—	—	—

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	—	—	—

4. 商業用不動産担保証券（CMBS）

（単位：億円）

	時価	（参考）	含み損益	実現損益
		平成24年3月末		
商業用不動産担保証券（CMBS）	8	8	△0	—
国内	8	8	△0	—

5. レバレッジド・ファイナンス

（単位：億円）

	時価	（参考）	含み損益	実現損益
		平成24年3月末		
レバレッジド・ファイナンス	—	—	—	—

【合計（1～5の証券化商品）】

（単位：億円）

	時価	含み損益	実現損益
合計	8	△0	—
うちサブプライム関連	—	—	—

6. その他

①住宅ローン担保証券 (RMBS)

《住宅金融支援機構債券・住宅金融公庫債券（時価合計 992億円）を除く》

- ・時価 730億円（含み損益 +44億円）
- ・裏付資産は、すべて国内の民間金融機関（メガバンク中心）の住宅ローン

②クレジットリンクローン

- ・貸付残高 290億円
- ・主な裏付資産は、欧米の企業向けの複数債権

③ヘッジファンド

- ・時価 418億円（含み損益 △61億円）
- ・主な投資先は、米国
- ・ファンド・オブ・ファンズが中心

【サブプライム関連商品への投資について】

- ①、②につきましては、サブプライム関連商品を含んでおりません。
③ヘッジファンドにつきましては、運用会社への調査を通じてファンド・オブ・ファンズの中の一部のファンドにおいてサブプライム関連商品への投資を確認しておりますが、平成24年6月末基準の投資額は買いポジション約9億円、売りポジション約1億円となっております。