

【ご参考】証券化商品への投資およびサブプライム関連投資の状況

1. 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 | — | — | — |
| ABCP | — | — | — |
| うち当社が組成するSPEs | — | — | — |
| SIV | — | — | — |
| うち当社が組成するSPEs | — | — | — |

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) | 455 | ▲ 64 | ▲ 236 |
| ABS-CDO | 1 | 0 | ▲ 29 |
| シニア | 1 | 0 | ▲ 29 |
| うちサブプライム・AltAエクスポージャー(※1) | 1 | 0 | ▲ 29 |
| メザニン | — | — | — |
| エクイティ | — | — | — |
| CLO | 83 | ▲ 43 | — |
| シニア | — | — | — |
| メザニン | 83 | ▲ 43 | — |
| エクイティ | — | — | — |
| CBO | — | — | — |
| シニア | — | — | — |
| メザニン | — | — | — |
| エクイティ | — | — | — |
| その他のCDO(※2) | 370 | ▲ 22 | ▲ 207 |
| シニア | 196 | ▲ 18 | ▲ 74 |
| メザニン | 173 | ▲ 3 | ▲ 133 |
| エクイティ | — | — | — |

※1 サブプライム・Alt-A関連のエクスポージャーを持つ銘柄全体の金額を記載しております。なお、該当銘柄(1銘柄)の格付は、AAA格であります。当社におけるサブプライム・Alt-A関連のエクスポージャーは本欄記載以外にありません。

※2 「その他のCDO」には、企業および国のクレジットを参照するCDOを記載しております。

※3 上記CDOの格付別内訳は、AAA格：15億円(全体に占める割合3.4%)、AA格：150億円(同33.1%)、A格：126億円(同27.8%)、BBB格：155億円(同34.2%)、BB格：6億円(同1.5%)となっております。

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 | — | — | — |
| 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 | — | — | — |

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 |
|-------------------|-----|------|------|
| 商業用不動産担保証券 (CMBS) | 127 | 0 | — |
| 日本 | 127 | 0 | — |
| 米国 | — | — | — |
| 欧州 | — | — | — |
| 英国 | — | — | — |
| その他 | — | — | — |

5. 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 |
|---------------|----|------|------|
| レバレッジド・ファイナンス | — | — | — |
| 通信 | — | — | — |
| 電機 | — | — | — |
| 娯楽 | — | — | — |

6. その他の証券化商品

(単位:億円)

| | 時価 | 含み損益 | 実現損益 |
|------------|-------|------|------|
| RMBS(※1) | 3,518 | 29 | 9 |
| 円建 | 2,673 | 22 | — |
| 外貨建 | 845 | 6 | 9 |
| 上記以外の証券化商品 | 2,717 | ▲ 39 | ▲ 0 |

※1 このほかに、特別勘定にて保有するRMBS (時価: 37億円、実現損益: 0億円) があります。なお、特別勘定にて保有する有価証券は全て売買目的有価証券であるため、含み損益はありません。

- (注) 1. 時価は、債券の市場価格 (デリバティブを内包するものについてはデリバティブ部分の評価損益との合計) を記載しております。
当該時価は全てブローカー等から提供されたものを採用しており、当社内部で理論価格を算出したものではありません。
2. 含み損益は、外貨建その他有価証券の為替換算差額を損益計算書に計上した後のベースで記載しております。
3. 実現損益は、売却損益および複合金融商品の区分処理に伴う損益を対象としております。
(複合金融商品の区分処理とは、企業会計基準適用指針第12号に則り、複合金融商品を債券部分と組み込まれたデリバティブ部分に区分して処理することです。なお、デリバティブ部分については評価差額を当期の損益として計上しております。)

以上