

証券化商品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(SPEs)一般

(単位:億円)

	当第3四半期会計期間末 (平成20年12月31日)			前事業年度末 (平成20年3月31日)		
	時価	含み損益	実現損益	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)

	当第3四半期会計期間末 (平成20年12月31日)			前事業年度末 (平成20年3月31日)		
	時価	含み損益	実現損益	時価	含み損益	実現損益
債務担保証券(CDO)	93	▲ 36	▲ 256	455	▲ 64	▲ 236
ABS-CDO	—	—	0	1	0	▲ 29
シニア	—	—	0	1	0	▲ 29
うちサブプライム・Alt-Aエクスポージャー(※1)	—	—	0	1	0	▲ 29
メザニン	—	—	—	—	—	—
エクイティ	—	—	—	—	—	—
CLO	9	—	▲ 116	83	▲ 43	—
シニア	—	—	—	—	—	—
メザニン	9	—	▲ 116	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)	83	▲ 36	▲ 140	370	▲ 22	▲ 207
シニア	69	▲ 22	▲ 78	196	▲ 18	▲ 74
メザニン	14	▲ 14	▲ 61	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、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、企業及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の格付別内訳は以下のとおりです。

(当第3四半期会計期間末…AAA格:31億円(全体に占める割合34.1%)、AA格:7億円(同7.9%)、A格:16億円(同17.6%)、BBB格:9億円(同10.1%)、BB格:20億円(同22.1%)、B格:0億円(同0.9%)、格付なし:6億円(同7.3%)、前事業年度末…AAA格:15億円(同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%))

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)

	当第3四半期会計期間末 (平成20年12月31日)			前事業年度末 (平成20年3月31日)		
	時価	含み損益	実現損益	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)

	当第3四半期会計期間末 (平成20年12月31日)			前事業年度末 (平成20年3月31日)		
	時価	含み損益	実現損益	時価	含み損益	実現損益
商業用不動産担保証券 (CMBS)	71	0	—	127	0	—
日本	71	0	—	127	0	—
米国	—	—	—	—	—	—
欧州	—	—	—	—	—	—
英国	—	—	—	—	—	—
その他	—	—	—	—	—	—

5. レバレッジ・ファイナンス

(単位:億円)

	当第3四半期会計期間末 (平成20年12月31日)			前事業年度末 (平成20年3月31日)		
	時価	含み損益	実現損益	時価	含み損益	実現損益
レバレッジ・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)

	当第3四半期会計期間末 (平成20年12月31日)			前事業年度末 (平成20年3月31日)		
	時価	含み損益	実現損益	時価	含み損益	実現損益
RMBS (※1)	3,711	38	0	3,518	29	9
円建	3,012	20	—	2,673	22	—
外貨建 (※2)	698	17	0	845	6	9
上記以外の証券化商品 (※3)	2,161	▲ 103	▲ 14	2,717	▲ 39	▲ 0

※1 このほかに、特別勘定においてRMBS (住宅金融支援機構債券 [旧住宅金融公庫債券]) を保有しており、その時価及び実現損益は以下のとおりです。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。

(当第3四半期会計期間末…時価: 30億円、実現損益: 0億円、前事業年度末…時価: 37億円、実現損益: ▲0億円)

※2 外貨建のRMBSは、全て米国政府系機関及び米国政府支援機関のMBSです。(なお、これら証券化商品とは別に、当該機関に係る社債を保有しており、当第3四半期会計期間末は時価45億円 [含み損益0億円]、前事業年度末は時価106億円 [含み損益4億円] となっています。)

※3 主な内訳は、リバース・デュアル・カレンシー債、CMS債、クレジットリンク債となっています。

7. 証券化商品合計 (上記1~6合計)

(単位:億円)

	当第3四半期会計期間末 (平成20年12月31日)			前事業年度末 (平成20年3月31日)		
	時価	含み損益	実現損益	時価	含み損益	実現損益
証券化商品合計	6,037	▲ 101	▲ 271	6,819	▲ 74	▲ 227

(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。当該時価は主にブローカー等から提供されたものを採用しておりますが、ブローカー等からの時価入手が出来ない一部のものについては、当社内部で算出した理論価格を採用しております。

2. 含み損益は、外貨建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、評価損及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