

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1四半期会計期間末 (平成21年6月30日)			前事業年度末 (平成21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1四半期会計期間末 (平成21年6月30日)			前事業年度末 (平成21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)	69	▲6	19	50	▲5	▲335
ABS-CDO	—	—	—	—	—	0
シニア	—	—	—	—	—	0
うちサブプライム・Alt-Aエクスポージャー(※1)	—	—	—	—	—	0
メザニン	—	—	—	—	—	—
エクイティ	—	—	—	—	—	—
CLO	—	—	—	—	—	▲124
シニア	—	—	—	—	—	—
メザニン	—	—	—	—	—	▲124
エクイティ	—	—	—	—	—	—
CBO	—	—	—	—	—	—
シニア	—	—	—	—	—	—
メザニン	—	—	—	—	—	—
エクイティ	—	—	—	—	—	—
その他のCDO(※2)	69	▲6	19	50	▲5	▲211
シニア	57	▲5	13	42	▲5	▲118
メザニン	12	▲0	6	7	0	▲92
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1四半期会計期間末…AAA格:34億円(全体に占める割合50.2%)、A格:20億円(同29.6%)、BB格:14億円(同20.2%)、前事業年度末…AAA格:27億円(全体に占める割合55.1%)、AA格:8億円(同16.1%)、A格:7億円(同15.1%)、BB格:6億円(同13.6%))

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1四半期会計期間末 (平成21年6月30日)			前事業年度末 (平成21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1四半期会計期間末 (平成21年6月30日)			前事業年度末 (平成21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)	50	▲1	—	51	▲0	—
日本	50	▲1	—	51	▲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)

	当第1四半期会計期間末 (平成21年6月30日)			前事業年度末 (平成21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)

	当第1四半期会計期間末 (平成21年6月30日)			前事業年度末 (平成21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)	3,434	14	—	3,545	▲16	▲4
円建	2,877	▲5	—	2,924	▲37	—
外貨建(※2)	557	19	—	621	21	▲4
上記以外の証券化商品(※3)	1,986	▲35	▲24	2,004	▲120	▲16

※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1四半期会計期間末…時価:4.3億円、実現損益:該当なし、前事業年度末…時価:2.8億円、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MB Sです。

※3 主な内訳は、リバース・デュアル・カレンシー債、CMS債等となっております。

7. 証券化商品合計(上記1~6合計)

(単位:億円)

	当第1四半期会計期間末 (平成21年6月30日)			前事業年度末 (平成21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	5,540	▲28	▲4	5,651	▲142	▲357

(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、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