

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)

	前事業年度末 (平成24年3月31日)			当中間会計期間末 (平成24年9月30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)

	前事業年度末 (平成24年3月31日)			当中間会計期間末 (平成24年9月30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)	—	—	—	—	—	—
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	—	—	—	—	—	—
エクイティ	—	—	—	—	—	—
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	—	—	—	—	—	—
その他のCDO	—	—	—	—	—	—
シニア	—	—	—	—	—	—
メザニン	—	—	—	—	—	—
エクイティ	—	—	—	—	—	—

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)

	前事業年度末 (平成24年3月31日)			当中間会計期間末 (平成24年9月30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)

	前事業年度末 (平成24年3月31日)			当中間会計期間末 (平成24年9月30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)	26	▲ 0	—	26	▲ 0	—
日本	26	▲ 0	—	26	▲ 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)

	前事業年度末 (平成24年3月31日)			当中間会計期間末 (平成24年9月30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)

	前事業年度末 (平成24年3月31日)			当中間会計期間末 (平成24年9月30日)		
	時価	含み損益	実現損益	時価	含み損益	実現損益
RMBS(※1)	2,434	101	▲ 5	2,152	110	11
円建	1,851	84	1	1,554	87	11
外貨建(※2)	583	17	▲ 7	598	22	—
上記以外の証券化商品(※3)	1,237	▲ 15	▲ 30	1,161	▲ 17	▲ 13

※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。

(前事業年度末…時価:34億円、実現損益:該当なし、当中間会計期間末…時価:34億円、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。

※3 主な内訳は、リバース・デュアル・カレンシー債、クレジットリンク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)

	前事業年度末 (平成24年3月31日)			当中間会計期間末 (平成24年9月30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	3,698	86	▲ 36	3,340	92	▲ 2

- (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。
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