

平成21年度第3四半期 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

平成22年2月12日

ピーシーエー生命保険株式会社

ピーシーエー生命保険株式会社(代表取締役社長ジュリアン・リップマン)の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(平成21年12月末)について以下のとおりお知らせいたします。

【 投資状況 】

(単位:億円)

		時価	含み損益	実現損益
債務担保証券(CDO)		36	28	-
ABS-CDO	シニア(スーパーシニア)	36	28	-
	うちサブプライム・Alt-A エクスポージャー	-	-	-
	メザニン	-	-	-
	うちサブプライム・Alt-A エクスポージャー	-	-	-
	エクイティ	-	-	-
	うちサブプライム・Alt-A エクスポージャー	-	-	-
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	シニア	-	-	-
	メザニン	-	-	-
	エクイティ	-	-	-

* クレジットリンク債1銘柄を保有し、スタンダード・アンド・プアーズにより平成21年12月31日時点においてBと格付されています。