

平成22年度第1四半期 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8月13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 加藤 隆)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22年6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) | | 34 | 26 | - |
| ABS-CDO | シニア(スーパーシニア) | 34 | 26 | - |
| | 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22年6月30日時点においてBと格付されています。