

平成20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21年2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20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) | | 9 | 8 | - |
| ABS-CDO | シニア(スーパーシニア) | 9 | 8 | - |
| | 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 | - | - | - |

格付別内訳

| スタンダード・アンド・プアーズ格付 | |
|-------------------|---------|
| AAA | - |
| AA | 3.00% |
| A | 17.00% |
| BBB | 79.00% |
| BB | 1.00% |
| B | - |
| CCC | - |
| 合計 | 100.00% |

国別内訳

| 国名 | 占率 |
|--------|---------|
| 米国 | 52.67% |
| 英国 | 15.33% |
| フランス | 7.33% |
| ドイツ | 7.33% |
| バーミューダ | 2.00% |
| スイス | 2.00% |
| メキシコ | 1.33% |
| 韓国 | 1.33% |
| スウェーデン | 1.33% |
| その他 | 9.33% |
| 合計 | 100.00% |