

平成20年度末 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5月29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3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)		7	-	-
ABS-CDO	シニア(スーパーシニア)	7	-	-
	うちサブプライム・Alt-A エクスポーザー	-	-	-
	メザニン	-	-	-
	うちサブプライム・Alt-A エクスポーザー	-	-	-
	エクイティ	-	-	-
	うちサブプライム・Alt-A エクスポーザー	-	-	-
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	3.38%
A	9.46%
BBB	55.40%
BB	14.86%
B	3.38%
CCC	0.68%
D	0.68%
NR	12.16%
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%
パーミューダ	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%