

平成21年度第2四半期 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11月25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9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)		32	24	-
ABS-CDO	シニア(スーパーシニア)	32	24	-
	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	2.67%
A	8.67%
BBB	55.33%
BB	12.00%
B	5.33%
CCC	2.00%
D	0.67%
NR	13.33%
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%