

平成23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23年8月11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(代表執行役社長 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23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)		38	30	-
ABS-CDO	シニア(スーパーシニア)	38	30	-
	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23年6月30日時点においてBと格付されています。