

平成23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23年11月24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) |                         | 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9月30日時点においてBと格付されています。