

平成23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24年2月14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)		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12月31日時点においてBと格付されています。