

平成24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24年8月13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24年6月末)について、以下のとおりお知らせいたします。

1. 特別目的事業体(SPEs)一般

該当ありません。

2. 債務担保証券(CDO)

(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24年6月30日時点においてBBBと格付されています。

3. その他のサブプライム・Alt-Aエクスポージャー

該当ありません。

4. 商業用不動産担保証券(CMBS)

該当ありません。

5. レバレッジド・ファイナンス

該当ありません。