

平成22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22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(代表取締役社長 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22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)		34	26	-
ABS-CDO	シニア(スーパーシニア)	34	26	-
	うちサブプライム・Alt-A エクスポート			
	メザニン			
	うちサブプライム・Alt-A エクスポート			
	エクイティ			
	うちサブプライム・Alt-A エクスポート			
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22年6月30日時点においてBと格付されています。