

2011年度第3四半期末業績のお知らせ

2011年度第3四半期末(2011年4月1日～2011年12月31日)の業績をお知らせします。

<目次>

1. 主要業績	1
2. 資産運用の実績(一般勘定)	2
3. 四半期貸借対照表	5
4. 四半期損益計算書	6
5. 経常利益等の明細(基礎利益)	9
6. ソルベンシー・マージン比率	10
7. 特別勘定の状況	12
8. 保険会社及びその子会社等の状況	12
<参考資料>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	13

本件に関するお問い合わせ先:
アクサ生命保険株式会社 広報部
TEL: 03-6737-7140 FAX: 03-6737-5964

1. 主要業績

(1)保有契約高及び新契約高

保有契約高

(単位:千件、億円、%)

区分	2010年度末		2011年度第3四半期会計期間末			
	件数	金額	件数		金額	
			前年度末比	前年度末比		
個人保険	3,648	131,896	3,696	101.3%	130,422	98.9%
個人年金保険	334	17,824	335	100.2%	18,135	101.7%
団体保険	—	52,848	—	—	45,935	86.9%
団体年金保険	—	6,565	—	—	6,262	95.4%

(注)1.個人年金保険については、年金支払開始前契約の年金支払開始時における年金原資と年金支払開始後契約の責任準備金を合計したものです。(ただし、変額個人年金保険の年金支払開始前契約については、基本保険金額(既払込保険料相当額)を計上しています。)

2.団体年金保険については、責任準備金の金額です。

新契約高

(単位:千件、億円、%)

区分	2010年度第3四半期累計期間				2011年度第3四半期累計期間					
	件数	金額			件数		金額			
		新契約	転換による純増加		前年同期比	前年同期比	新契約	転換による純増加		
個人保険	231	9,063	9,050	13	281	121.9%	9,518	105.0%	9,507	10
個人年金保険	8	592	631	△38	12	146.7%	905	152.9%	940	△34
団体保険	—	92	92	—	—	—	46	50.7%	46	—
団体年金保険	—	0	0	—	—	—	0	46.1%	0	—

(注)1.件数は、新契約に転換後契約を加えた数値です。

2.新契約・転換による純増加の個人年金保険の金額は年金支払開始時における年金原資です。(ただし、変額個人年金保険については、初回保険料相当額を計上しています。)

3.新契約の団体年金保険の金額は第1回収入保険料です。

(2)年換算保険料

保有契約

(単位:百万円、%)

区分	2010年度末	2011年度第3四半期会計期間末	
		前年度末比	前年度末比
個人保険	398,774	390,141	97.8%
個人年金保険	157,906	170,345	107.9%
合計	556,680	560,487	100.7%
うち医療保障・生前給付保障等	199,691	197,162	98.7%

新契約

(単位:百万円、%)

区分	2010年度第3四半期累計期間	2011年度第3四半期累計期間	
		前年同期比	前年同期比
個人保険	24,811	25,491	102.7%
個人年金保険	27,962	37,357	133.6%
合計	52,773	62,848	119.1%
うち医療保障・生前給付保障等	11,486	11,783	102.6%

(注)1.年換算保険料とは、1回あたりの保険料について保険料の支払方法に応じた係数を乗じ、1年あたりの保険料に換算した金額です。(一時払契約等は、保険料を保険期間で除した金額)

2.「うち医療保障・生前給付保障等」については、医療保障給付(入院給付、手術給付等)、生前給付保障給付(特定疾病給付、介護給付等)、保険料払込免除給付(障害を事由とするものは除く。特定疾病罹患、介護等を事由とするものを含む。)等に該当する部分の年換算保険料を計上しています。

2. 資産運用の実績(一般勘定)

(1)資産の構成

(単位:百万円、%)

区 分	2010年度末		2011年度第3四半期会計期間末	
	金額	占率	金額	占率
現預金・コールローン	76,984	1.5	87,097	1.7
買現先勘定	—	—	—	—
債券貸借取引支払保証金	24,945	0.5	80,755	1.6
買入金銭債権	927	0.0	928	0.0
商品有価証券	—	—	—	—
金銭の信託	270,412	5.4	257,918	5.1
有価証券	4,378,082	86.9	4,373,008	85.9
公社債	2,365,206	46.9	2,437,680	47.9
株式	48,390	1.0	32,402	0.6
外国証券	1,961,065	38.9	1,895,386	37.2
公社債	389,796	7.7	323,973	6.4
株式等	1,571,268	31.2	1,571,413	30.9
その他の証券	3,420	0.1	7,538	0.1
貸付金	150,279	3.0	145,235	2.9
不動産	4,760	0.1	4,644	0.1
繰延税金資産	53,969	1.1	55,604	1.1
その他	81,088	1.6	92,182	1.8
貸倒引当金	△ 4,943	△ 0.1	△ 4,781	△ 0.1
合 計	5,036,507	100.0	5,092,592	100.0
うち外貨建資産	126,956	2.5	117,998	2.3

(注) 1.不動産については土地・建物を合計した金額を計上しています。

2.外国証券(株式等)には外国投資信託(債券型)を含んでおり、その金額は2011年度第3四半期会計期間末では1,452,013百万円です。(2010年度末1,459,985百万円)

(2)有価証券の時価情報(売買目的有価証券以外の有価証券のうち時価のあるもの)

(単位:百万円)

区分	2010年度末					2011年度第3四半期会計期間末				
	帳簿価額	時価	差損益			帳簿価額	時価	差損益		
				差益	差損				差益	差損
満期保有目的の債券	400,587	425,032	24,445	29,228	4,782	394,758	404,811	10,052	27,504	17,451
責任準備金対応債券	567,262	581,891	14,628	18,070	3,441	563,830	604,228	40,397	40,397	-
子会社・関連会社株式	—	—	—	—	—	-	-	-	-	-
その他有価証券	3,323,102	3,405,042	81,939	92,474	10,534	3,336,810	3,404,014	67,204	100,042	32,837
公社債	1,594,475	1,617,756	23,280	27,761	4,480	1,622,158	1,690,073	67,914	68,199	284
株式	32,314	47,841	15,526	16,631	1,105	20,462	31,853	11,391	12,502	1,111
外国証券	1,694,382	1,737,769	43,387	48,080	4,693	1,692,271	1,680,362	△11,909	19,340	31,250
公社債	161,960	169,395	7,435	7,789	354	110,847	112,990	2,142	3,868	1,726
株式等	1,532,421	1,568,373	35,952	40,291	4,339	1,581,424	1,567,371	△14,052	15,471	29,524
その他の証券	929	747	△182	0	182	916	796	△120	-	120
買入金銭債権	1,000	927	△73	-	73	1,000	928	△71	-	71
譲渡性預金	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
その他	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
合 計	4,290,952	4,411,966	121,014	139,773	18,759	4,295,399	4,413,054	117,654	167,944	50,289
公社債	2,341,925	2,389,501	47,576	55,498	7,922	2,369,765	2,497,315	127,550	127,835	284
株式	32,314	47,841	15,526	16,631	1,105	20,462	31,853	11,391	12,502	1,111
外国証券	1,914,782	1,972,949	58,166	67,642	9,476	1,903,254	1,882,159	△21,095	27,606	48,701
公社債	382,361	404,575	22,214	27,351	5,136	321,830	314,787	△7,042	12,135	19,177
株式等	1,532,421	1,568,373	35,952	40,291	4,339	1,581,424	1,567,371	△14,052	15,471	29,524
その他の証券	929	747	△182	0	182	916	796	△120	-	120
買入金銭債権	1,000	927	△73	-	73	1,000	928	△71	-	71
譲渡性預金	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
その他	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

(注)1.本表には、金融商品取引法上の有価証券として取り扱うことが適当と認められるもの等を含んでいます。

2.金銭の信託を本表は含んでいません。

・時価を把握することが極めて困難と認められる有価証券の帳簿価額は以下のとおりです。

(単位:百万円)

区分	2010年度末	2011年度第3四半期会計期間末
満期保有目的の債券	—	-
非上場外国債券	—	-
その他	—	-
責任準備金対応債券	—	-
子会社・関連会社株式	—	-
その他有価証券	6,117	11,332
非上場国内株式 (店頭売買株式を除く)	549	548
非上場外国株式 (店頭売買株式を除く)	0	0
非上場外国債券	—	-
その他	5,567	10,784
合 計	6,117	11,332

(3)金銭の信託の時価情報

(単位:百万円)

区 分	2010年度末					2011年度第3四半期会計期間末				
	貸借 対照表 計上額	時価	差損益			貸借 対照表 計上額	時価	差損益		
				差益	差損				差益	差損
金銭の信託	270,412	287,527	17,115	17,115	—	257,918	282,208	24,290	24,290	—

・運用目的の金銭の信託

該当ありません。

・満期保有目的、責任準備金対応、その他の金銭の信託

(単位:百万円)

区 分	2010年度末					2011年度第3四半期会計期間末				
	帳簿価額	時価	差損益			帳簿価額	時価	差損益		
				差益	差損				差益	差損
満期保有目的の 金銭の信託	220,802	237,918	17,115	17,115	—	223,304	247,594	24,290	24,290	—
責任準備金対応 の金銭の信託	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
その他の金銭の 信託	49,954	49,609	△ 344	5,207	5,551	33,076	34,613	1,537	4,049	2,512

3. 四半期貸借対照表

(単位:百万円)

科目	期別	2010年度末 要約貸借対照表 (2011年3月31日現在)	2011年度 第3四半期 会計期間末 (2011年12月31日現在)	科目	期別	2010年度末 要約貸借対照表 (2011年3月31日現在)	2011年度 第3四半期 会計期間末 (2011年12月31日現在)
		金額	金額			金額	金額
(資産の部)				(負債の部)			
現金及び預貯金		31,309	44,608	保険契約準備金		4,557,315	4,581,473
コールローン		50,562	47,821	支払備金		55,444	42,582
債券貸借取引支払保証金		24,945	80,755	責任準備金		4,484,867	4,522,818
買入金銭債権		927	928	契約者配当準備金		17,002	16,072
金銭の信託		270,412	257,918	代理店借		1,183	1,172
有価証券		5,013,863	5,034,367	再保険借		1,251	6,485
(うち国債)		(2,321,594)	(2,400,735)	その他負債		849,339	936,522
(うち地方債)		(6,085)	(1,894)	未払法人税等		265	194
(うち社債)		(37,526)	(35,049)	リース債務		39	32
(うち株式)		(48,390)	(32,402)	資産除去債務		1,247	1,251
(うち外国証券)		(2,033,751)	(1,958,978)	その他の負債		847,787	935,043
貸付金		150,279	145,235	退職給付引当金		37,711	38,046
保険約款貸付		81,390	81,065	役員退職慰労引当金		867	809
一般貸付		68,889	64,169	価格変動準備金		23,246	25,016
有形固定資産		4,973	4,838	負債の部合計		5,470,914	5,589,527
無形固定資産		6,920	7,342	(純資産の部)			
代理店貸		3,033	3,020	資本金		60,500	60,500
再保険貸		873	8,576	資本剰余金		43,312	31,220
その他資産		76,007	79,024	資本準備金		25,677	28,096
繰延税金資産		53,969	55,604	その他資本剰余金		17,634	3,124
貸倒引当金		△4,943	△4,781	利益剰余金		56,357	36,470
				利益準備金		14,311	21,318
				その他利益剰余金		42,046	15,151
				繰越利益剰余金		42,046	15,151
				株主資本合計		160,170	128,191
				その他有価証券評価差額金		52,049	47,542
				評価・換算差額等合計		52,049	47,542
				純資産の部合計		212,220	175,733
資産の部合計		5,683,134	5,765,260	負債及び純資産の部合計		5,683,134	5,765,260

4. 四半期損益計算書

(単位:百万円)

科目	期別	2010年度 第3四半期累計期間 (2010年4月1日から 2010年12月31日まで)	2011年度 第3四半期累計期間 (2011年4月1日から 2011年12月31日まで)
		金額	金額
経常収益		629,604	595,266
保険料等収入		471,065	490,360
(うち保険料)		(468,728)	(480,108)
資産運用収益		155,227	89,555
(うち利息及び配当金等収入)		(66,198)	(68,040)
(うち金銭の信託運用益)		(5,576)	(1,016)
(うち有価証券売却益)		(66,662)	(3,448)
(うち金融派生商品収益)		(16,164)	(16,511)
その他経常収益		3,311	15,350
経常費用		531,621	564,391
保険金等支払金		363,256	380,432
(うち保険金)		(59,610)	(63,487)
(うち年金)		(38,089)	(43,412)
(うち給付金)		(86,856)	(81,934)
(うち解約返戻金)		(153,814)	(156,283)
(うちその他返戻金)		(15,433)	(20,475)
責任準備金等繰入額		39,840	37,974
支払準備金繰入額		800	—
責任準備金繰入額		39,013	37,950
契約者配当金積立利息繰入額		25	24
資産運用費用		49,952	66,998
(うち支払利息)		(644)	(775)
(うち有価証券売却損)		(8,540)	(21,648)
(うち有価証券評価損)		(327)	(1,259)
(うち特別勘定資産運用損)		(18,652)	(33,751)
事業費		72,450	72,740
その他経常費用		6,121	6,245
経常利益		97,983	30,874
特別利益		—	4
固定資産等処分益		—	4
特別損失		2,764	2,055
固定資産等処分損		62	42
価格変動準備金繰入額		1,788	1,770
その他特別損失		914	242
契約者配当準備金繰入額		6,876	6,770
税引前四半期純利益		88,341	22,052
法人税及び住民税		192	188
法人税等調整額		△ 6,425	6,711
法人税等合計		△ 6,232	6,900
四半期純利益		94,574	15,151

注記事項

(四半期貸借対照表及び株主資本等変動計算書関係)

2011年度第3四半期会計期間末				
1. 消費貸借契約により貸し付けている有価証券の四半期貸借対照表価額は、834,953百万円であります。				
2. 契約者配当準備金の異動状況は次のとおりであります。				
当期首現在高	17,002百万円			
当第3四半期累計期間契約者配当金支払額	7,724百万円			
利息による増加等	24百万円			
契約者配当準備金繰入額	6,770百万円			
当第3四半期会計期間末現在高	16,072百万円			
3. 配当金支払額				
(1) 2011年6月10日の取締役会において、以下のとおり決議しております。				
・普通株式の配当に関する事項				
①配当財産の種類	日本国債及びその経過利息			
②配当財産の帳簿価額	19,374百万円			
③1株当たり配当額	91,954円31銭			
④基準日	2011年3月31日			
⑤効力発生日	2011年6月10日			
(2) 2011年12月7日の取締役会において、以下のとおり決議しております。				
・普通株式の配当に関する事項				
①配当財産の種類	日本国債及びその経過利息並びに日本株式			
②配当財産の帳簿価額	27,756百万円			
③1株当たり配当額	131,733円89銭			
④基準日	2011年9月30日			
⑤効力発生日	2011年12月7日			
4. 株主資本の金額の著しい変動				
				(単位:百万円)
	資本金	資本剰余金	利益剰余金	株主資本合計
当期首残高	60,500	43,312	56,357	160,170
当第3四半期会計期間末までの変動額				
剰余金の配当 (うち当第3四半期累計期間配当)		△ 12,092 (△ 12,092)	△ 35,038 (△ 15,663)	△ 47,131 (△ 27,756)
四半期純利益			15,151	15,151
当第3四半期会計期間末までの変動額合計	—	△ 12,092	△ 19,886	△ 31,979
当第3四半期会計期間末残高	60,500	31,220	36,470	128,191
5. 追加情報				
(1) 会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準等				
当第3四半期累計期間の期首以後に行われる会計上の変更及び過去の誤謬の訂正より、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」(2009年12月4日 企業会計基準第24号)及び「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」(2009年12月4日 企業会計基準適用指針第24号)を適用しております。				
(2) 金融商品会計に関する実務指針				
当第3四半期累計期間より、「金融商品会計に関する実務指針」(日本公認会計士協会会計制度委員会報告第14号)の改正に伴い保険業法施行規則が改正されたため、従来、特別利益に表示していた貸倒引当金戻入額は、資産運用収益又はその他経常収益に含めて表示しております。				
(3) 平成23年度改正法人税法及び復興財源確保法				
「経済社会の構造の変化に対応した税制の構築を図るための所得税法等の一部を改正する法律」(2011年 法律第114号)及び「東日本大震災からの復興のための施策を実施するために必要な財源の確保に関する特別措置法」(2011年 法律第117号)の公布に伴い、繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用する法定実効税率36.21%は、回収又は支払が見込まれる期間が2012年4月1日から2015年3月31日までのものについては33.33%、2015年4月1日以降のものについては30.78%にそれぞれ変更されております。この変更により、当第3四半期会計期間末における繰延税金資産の純額が5,630百万円減少しております。				

(四半期損益計算書関係)

2011年度第3四半期累計期間

1株当たり四半期純利益は71,912円41銭であります。

5. 経常利益等の明細(基礎利益)

(単位:百万円)

	2010年度 第3四半期累計期間	2011年度 第3四半期累計期間
基礎利益 A	36,959	43,382
キャピタル収益	82,850	19,960
金銭の信託運用益	23	—
売買目的有価証券運用益	—	—
有価証券売却益	66,662	3,448
金融派生商品収益	16,164	16,511
為替差益	—	—
その他キャピタル収益	—	—
キャピタル費用	22,393	32,912
金銭の信託運用損	—	4,527
売買目的有価証券運用損	—	—
有価証券売却損	8,313	21,209
有価証券評価損	327	1,259
金融派生商品費用	—	—
為替差損	12,761	5,877
その他キャピタル費用	990	38
キャピタル損益 B	60,457	△12,952
キャピタル損益含み基礎利益 A+B	97,416	30,430
臨時収益	580	541
再保険収入	—	—
危険準備金戻入額	580	541
個別貸倒引当金戻入額	—	0
その他臨時収益	—	—
臨時費用	14	97
再保険料	—	—
危険準備金繰入額	—	—
個別貸倒引当金繰入額	14	—
特定海外債権引当勘定繰入額	—	—
貸付金償却	—	—
その他臨時費用	—	97
臨時損益 C	566	444
経常利益 A+B+C	97,983	30,874

(注)1.2010年度第3四半期累計期間における金銭の信託運用益のうち、5,552百万円はインカム・ゲインに係るものであるため、「基礎利益」に含めて記載しております。

2.2011年度第3四半期累計期間における金銭の信託運用益のうち、5,544百万円はインカム・ゲインに係るものであるため、「基礎利益」に含めて記載しております。

3.2010年度第3四半期累計期間におけるその他運用費用のうち、990百万円はキャピタル・ロスに係るものであるため、「その他キャピタル費用」に含めて記載しております。

4.2011年度第3四半期累計期間におけるその他運用費用のうち、38百万円はキャピタル・ロスに係るものであるため、「その他キャピタル費用」に含めて記載しております。

5.2010年度第3四半期累計期間における有価証券売却損及び為替差損のうち、226百万円及び7,379百万円は外貨建保険商品に係る為替関係損益に相当するため、「基礎利益」に含めて記載しております。

6.2011年度第3四半期累計期間における有価証券売却損及び為替差損のうち、438百万円及び2,995百万円は外貨建保険商品に係る為替関係損益に相当するため、「基礎利益」に含めて記載しております。

6. ソルベンシー・マージン比率

(単位:百万円)

項 目	2010年度末	2011年度 第3四半期会計期間末
ソルベンシー・マージン総額 (A)	459,648	432,208
資本金等	139,068	128,191
価格変動準備金	23,246	25,016
危険準備金	36,646	36,105
一般貸倒引当金	648	392
その他有価証券の評価差額×90%(マイナスの場合100%)	73,435	61,867
土地の含み損益×85%(マイナスの場合100%)	965	965
全期チルメル式責任準備金相当額超過額	170,383	168,418
負債性資本調達手段等	—	—
控除項目	—	—
その他	15,253	11,251
リスクの合計額 $\sqrt{(R_1 + R_8)^2 + (R_2 + R_3 + R_7)^2} + R_4$ (B)	88,212	88,040
保険リスク相当額 R_1	12,229	11,748
第三分野保険の保険リスク相当額 R_8	7,740	7,637
予定利率リスク相当額 R_2	16,471	16,343
資産運用リスク相当額 R_3	60,729	60,936
経営管理リスク相当額 R_4	2,075	2,062
最低保証リスク相当額 R_7	6,590	6,483
ソルベンシー・マージン比率 $\frac{(A)}{(1/2) \times (B)} \times 100$	1,042.1%	981.8%

(注)1.上記は、保険業法施行規則第86条、第87条及び1996年大蔵省告示第50号の規定に基づいて算出しています。

2.最低保証リスク相当額の算出に際しては、標準的方式を用いています。

(参考)新基準によるソルベンシー・マージン比率

(単位:百万円)

項 目	2010年度末	2011年度 第3四半期会計期間末
ソルベンシー・マージン総額 (A)	455,134	427,694
資本金等	139,068	128,191
価格変動準備金	23,246	25,016
危険準備金	36,646	36,105
一般貸倒引当金	648	392
その他有価証券の評価差額×90%(マイナスの場合100%)	73,435	61,867
土地の含み損益×85%(マイナスの場合100%)	965	965
全期チルメル式責任準備金相当額超過額	170,383	168,418
負債性資本調達手段等	—	—
全期チルメル式責任準備金相当額超過額及び負債性資本 調達手段等のうち、マージンに算入されない額	—	—
控除項目	—	—
その他	10,740	6,737
リスクの合計額 $\sqrt{(R_1 + R_8)^2 + (R_2 + R_3 + R_7)^2} + R_4$ (B)	149,592	149,427
保険リスク相当額 R_1	12,229	11,748
第三分野保険の保険リスク相当額 R_8	7,740	7,637
予定利率リスク相当額 R_2	39,024	38,693
資産運用リスク相当額 R_3	100,484	100,924
経営管理リスク相当額 R_4	3,297	3,284
最低保証リスク相当額 R_7	5,416	5,234
ソルベンシー・マージン比率 $\frac{(A)}{(1/2) \times (B)} \times 100$	608.4%	572.4%

(注) 1.2010年内閣府令第23号、2010年金融庁告示第48号により、ソルベンシー・マージン総額及びリスクの合計額の算出基準について一部変更(マージン算入の厳格化、リスク計測の厳格化・精緻化等)がなされております。当該変更は2011年度末から適用されます。上記は、仮に当該変更を2010年度末及び2011年度第3四半期会計期間末に適用したと仮定した場合の数値です。

2.最低保証リスク相当額の算出に際しては、標準的方式を用いています。

7. 特別勘定の状況

(1)特別勘定資産残高の状況

(単位:百万円)

区 分	2010年度末		2011年度第3四半期会計期間末	
	件数	金額	件数	金額
個人変額保険		137,952		128,441
個人変額年金保険		516,091		551,138
団体年金保険		—		—
特別勘定計		654,044		679,579

(注)個人変額年金保険の特別勘定資産残高には、株価指数連動追加年金付予定利率市場連動型年金保険の追加年金部分の特別勘定資産が含まれています。

(2)保有契約高

・個人変額保険

(単位:千件、百万円)

区 分	2010年度末		2011年度第3四半期会計期間末	
	件数	金額	件数	金額
変額保険(有期型)	92	1,254,544	94	1,341,659
変額保険(終身型)	127	867,007	122	829,813
合 計	220	2,121,552	217	2,171,473

・個人変額年金保険

(単位:千件、百万円)

区 分	2010年度末		2011年度第3四半期会計期間末	
	件数	金額	件数	金額
個人変額年金保険	97	579,648	104	644,361
合 計	97	579,648	104	644,361

8. 保険会社及びその子会社等の状況

該当ありません。

<参考資料>

アクサ生命は、2011年度第3四半期会計期間、債務担保証券(CDO)の実現益を68,000万円(税金考慮前)計上しています。そのうち、サブプライムローンのエクスポージャーによる収益に与える影響は限定的です。

なお、2011年度第3四半期会計期間(2011年12月末)時点のサブプライムローンのエクスポージャーは、ABS-CDOを通じて6,500万円、ファンドを通じて13億円をエクスポージャーとして保有しておりますが、総資産に占める割合は僅少です。金融安定化フォーラム(FSF)のガイドラインを踏まえた証券化商品等への投資の状況は以下のとおりです。

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

(2011年度第3四半期会計期間末管理会計ベース)

1.特別目的事業体(SPEs)一般

(単位:百万円)

	時価	含み損益	実現損益
特別目的事業体	902	△97	-
ABCP	-	-	-
うち当社が組成するSPEs	-	-	-
SIV	-	-	-
うち当社が組成するSPEs	-	-	-
その他(*1)	902	△97	-
うち当社が組成するSPEs	-	-	-

(*1) 日本国債を裏付資産とする証券化商品(債券)を1銘柄保有しております。
外部格付は付与されておりません。

2.債務担保証券(CDO)

(単位:百万円)

	時価	含み損益	実現損益
債務担保証券(CDO)	22,948	8,247	680
ABS-CDO	13,034	8,280	653
シニア及びメザニン(*2)	1,472	1,333	636
うちサブプライム・Alt-A エクスポージャー	65	24	-
エクイティ	11,561	6,947	16
うちサブプライム・Alt-A エクスポージャー	0	0	-
CLO	9,914	△33	26
シニア	9,914	△33	26
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	-	-	-

(*2) シニア及びメザニンの区分が不明瞭であるため合算で記載しております。

3. その他のサブプライム・Alt-Aエクスポージャー

(単位:百万円)

	時価	含み損益	実現損益
その他サブプライム・Alt-A エクスポージャー	1,347	170	0
証券化されていないローン	-	-	-
RMBS	-	-	-
デリバティブ	-	-	-
コミットメントライン	-	-	-
その他(*3)	1,347	170	0

(*3)時価14億円のファンドへの投資です。

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。

その他の事項

- (1)当社が投資する投資信託内において個別企業の信用リスクを参照するクレジットデフォルトスワップ(大部分が投資適格格付)を保有しておりますが、証券化商品を参照債務とするものは保有しておりません。
- (2)投資信託については、原則、開示の対象から除いております。