

平成20年8月12日

各 位

T & Dフィナンシャル生命保険株式会社
代表取締役社長 竹内 致夫

「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」について

T & D保険グループのT & Dフィナンシャル生命保険株式会社（社長：竹内 致夫）は、金融安定化フォーラム（FSF）のガイドラインを踏まえ、平成20年6月末時点における「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」について、別紙のとおりご報告いたします。

以 上

お問合せ：企画部広報課 稲生
電話：03-3434-8840

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20年6月末)

T&Dフィナンシャル生命保険株式会社

1. 投資状況

①特別目的事業体(SPEs)一般

(単位:億円)

	時価	差損益	実現損益
特別目的事業体(SPEs)一般	-	-	-
ABCP	-	-	-
SIV	-	-	-
その他	-	-	-

②債務担保証券(CDO)

(単位:億円)

	格付	時価	差損益	実現損益
債務担保証券(CDO)		2	△ 0	0
ABS-CDO		-	-	-
CLO		2	△ 0	0
シニア		0	△ 0	0
AAA		0	△ 0	0
AA		-	-	-
A以下		-	-	-
格付なし		-	-	-
メザニン		2	△ 0	0
AAA		-	-	-
AA		2	△ 0	0
A以下		-	-	-
格付なし		-	-	-
CBO		-	-	-
その他		-	-	-

③その他のサブプライム・ALT-Aエクスポージャー

(単位:億円)

	時価	差損益	実現損益
その他サブプライム・ALT-Aエクスポージャー	-	-	-

④商業用不動産担保証券(CMBS)

(単位:億円)

	時価	(参考) 平成20年3月末	差損益	実現損益
商業用不動産担保証券(CMBS)	-	-	-	-

⑤レバレッジド・ファイナンス

(単位:億円)

	時価	(参考) 平成20年3月末	差損益	実現損益
レバレッジド・ファイナンス	-	-	-	-

⑥その他

該当はありません。

(注) 実現損益には、利息配当金等収入などを含んでおります。

以 上