

Tokyo, Japan - 29 March 2019

## Press release

### エヌエヌ生命

### 平成 25 年度第 3 四半期決算報告 訂正のお知らせ

平成 30 年 5 月 29 日付「平成 29 年度決算ならびに過年度分の決算の訂正について」にてお知らせの通り、過年度決算の訂正に伴い、平成 25 年度第 3 四半期決算報告を訂正させていただきます。訂正箇所は\_\_線で示しています。

※ 本文に記載のある「アイエヌジー生命保険株式会社」は当社の旧社名です。2015 年 4 月に現社名へ商号変更を行いました。

本件に関するお問い合わせ先

エヌエヌ生命保険株式会社 広報部 TEL:03-5210-5599 FAX:03- 6685-7700

エヌエヌ生命は、オランダにルーツを持ち、170 年におよぶ伝統を誇る NN グループの一員です。NN グループは、欧州および日本を主な拠点とし、18 カ国にわたり、保険および資産運用事業を展開しています。その名は、源流である「ナショナル・ネーデルランデン」に由来しています。エヌエヌ生命は、1986 年に日本で初めてのヨーロッパ生まれの生命保険会社として営業を開始して以来、30 年以上にわたり、中小企業とその経営者が財務や財産の面で安定した将来を確保できるよう支援しております。

<目次>

1. 主要業績 .....	1 頁
2. 資産運用の実績(一般勘定) .....	3 頁
3. 四半期貸借対照表 .....	6 頁
4. 四半期損益計算書 .....	7 頁
5. 経常利益等の明細(基礎利益) .....	9 頁
6. ソルベンシー・マージン比率 .....	10 頁
7. 特別勘定の状況 .....	12 頁
8. 保険会社及びその子会社等の状況 .....	13 頁
<b>参考資料</b> 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 .....	14 頁

以上

# 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	平成 24 年度末		平成 25 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	394	50,434	401	101.8	61,018	121.0
個人年金保険	373	20,827	347	92.9	21,350	102.5
小 計	768	71,261	748	97.5	82,368	115.6
団 体 保 険	-	-	-	-	-	-
団体年金保険	-	-	-	-	-	-

(注) 個人年金保険の金額については、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(一時払変額年金保険については責任準備金(最低保証に係る部分を除く))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。

### ・ 新契約高

(単位:千件、億円、%)

区 分	平成 24 年度 第 3 四半期累計期間				平成 25 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	34	9,369	9,369	-	42	120.8	14,082	150.3	14,082	-
個人年金保険	0	1	1	-	0	76.9	0	71.4	0	-
小 計	34	9,370	9,370	-	42	120.7	14,082	150.3	14,082	-
団 体 保 険	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
団体年金保険	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

(注) 個人年金保険の金額については、年金支払開始時における年金原資(一時払変額年金保険については基本給付金額(一時払保険料と同額))です。

## (2)年換算保険料

### ・ 保有契約

(単位:百万円、%)

区 分	平成 24 年度末	平成 25 年度 第 3 四半期 会計期間末	前年度 末比
個 人 保 険	260,098	278,960	107.3
個 人 年 金 保 険	214,866	197,926	92.1
合 計	474,964	476,886	100.4
うち医療保障・ 生前給付保障等	164,069	176,618	107.6

### ・ 新契約

(単位:百万円、%)

区 分	平成 24 年度 第 3 四半期累計期間	平成 25 年度 第 3 四半期累計期間	前年 同期比
個 人 保 険	33,802	43,011	127.2
個 人 年 金 保 険	10	7	70.8
合 計	33,813	43,018	127.2
うち医療保障・ 生前給付保障等	21,039	28,347	134.7

(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. 「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)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	平成 24 年度末		平成 25 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	55,848	4.7	37,097	3.0
買 現 先 勘 定	-	-	-	-
債 券 貸 借 取 引 支 払 保 証 金	-	-	-	-
買 入 金 銭 債 権	-	-	-	-
商 品 有 価 証 券	-	-	-	-
金 銭 の 信 託	1,500	0.1	1,500	0.1
有 価 証 券	1,067,684	89.8	1,139,897	90.8
公 社 債	776,228	65.3	892,180	71.1
株 式	363	0.0	626	0.0
外 国 証 券	288,909	24.3	244,868	19.5
公 社 債	267,355	22.5	222,181	17.7
株 式 等	21,553	1.8	22,686	1.8
そ の 他 の 証 券	2,183	0.2	2,222	0.2
貸 付 金	14,199	1.2	16,027	1.3
不 動 産	320	0.0	300	0.0
繰 延 税 金 資 産	-	-	-	-
そ の 他	49,047	4.1	60,412	4.8
貸 倒 引 当 金	△105	0.0	△25	0.0
合 計	1,188,496	100.0	1,255,210	100.0
う ち 外 貨 建 資 産	150,846	12.7	156,454	12.5

## (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	平成 24 年度末					平成 25 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	16,936	17,596	660	966	306	16,010	16,680	669	942	272
責任準備金対応債券	663,125	714,240	51,115	51,562	447	774,814	811,618	36,803	37,267	464
子会社・関連会社株式	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
その他の有価証券	373,501	387,550	14,049	16,850	2,801	342,498	348,765	6,267	8,341	2,073
公 社 債	158,186	162,100	3,914	4,557	643	143,659	145,706	2,046	2,647	600
株 式	157	290	132	132	-	157	319	161	161	-
外 国 証 券	213,053	222,975	9,922	12,080	2,158	196,577	200,517	3,940	5,413	1,473
公 社 債	193,616	201,421	7,805	9,945	2,139	174,135	177,831	3,695	5,159	1,463
株 式 等	19,436	21,553	2,116	2,135	18	22,441	22,686	244	253	9
その他の証券	2,103	2,183	79	79	-	2,103	2,222	118	118	-
買入金銭債権	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
譲渡性預金	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
その他	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
合 計	1,053,562	1,119,387	65,824	69,380	3,555	1,133,323	1,177,064	43,740	46,551	2,810
公 社 債	772,314	822,351	50,037	50,689	651	890,134	926,441	36,307	37,301	993
株 式	157	290	132	132	-	157	319	161	161	-
外 国 証 券	278,986	294,561	15,574	18,478	2,903	240,927	248,079	7,151	8,968	1,816
公 社 債	259,549	273,007	13,457	16,343	2,885	218,486	225,393	6,907	8,714	1,807
株 式 等	19,436	21,553	2,116	2,135	18	22,441	22,686	244	253	9
その他の証券	2,103	2,183	79	79	-	2,103	2,222	118	118	-
買入金銭債権	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
譲渡性預金	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
その他	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

- ・ 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	平成 24 年度末	平成 25 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	-	-
その他の	-	-
責任準備金対応債券	-	-
子会社・関連会社株式	0	234
その他の有価証券	72	72
非上場国内株式(店頭売買株式を除く)	72	72
非上場外国株式(店頭売買株式を除く)	-	-
非上場外国債券	-	-
その他の	-	-
合 計	72	306

### (3) 金銭の信託の時価情報

(単位：百万円)

区 分	平成 24 年度末					平成 25 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	1,500	1,500	-	-	-	1,500	1,500	-	-	-

- ・ 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

該当ありません。

### 3. 四半期貸借対照表

(単位:百万円)

科目	期別	平成24年度末	平成25年度
		要約貸借対照表 (平成25年3月31日現在)	第3四半期会計期間末 (平成25年12月31日現在)
		金額	金額
(資産の部)			
現金及び預貯金		38,840	27,552
コーポレートローン		34,100	26,700
金銭の信託		1,500	1,500
有価証券		3,090,489	3,260,089
(うち国債)		(529,318)	(606,921)
(うち地方債)		(37,229)	(66,075)
(うち社債)		(209,680)	(219,183)
(うち株式)		(363)	(626)
(うち外国証券)		(288,909)	(244,868)
貸付金		14,199	16,027
保険約款貸付		14,159	16,027
一般貸付		40	-
有形固定資産		585	542
無形固定資産		1,822	1,672
代理店貸		49	21
再保険貸		40,445	36,032
その他資産		80,461	29,527
貸倒引当金		△105	△25
資産の部合計		<u>3,302,387</u>	<u>3,399,641</u>
(負債の部)			
保険契約準備金		3,156,788	3,298,271
支払準備金		39,853	47,340
責任準備金		3,116,935	3,250,930
代理店借		5,015	2,138
再保険借		5,006	4,297
その他負債		65,169	37,822
未払法人税等		942	-
その他の負債		64,227	37,822
退職給付引当金		4,587	5,045
役員退職慰労引当金		107	122
事業再編引当金		70	-
価格変動準備金		1,575	1,842
繰延税金負債		2,889	494
負債の部合計		<u>3,241,210</u>	<u>3,350,035</u>
(純資産の部)			
資本金		32,400	32,400
利益剰余金		19,052	12,867
利益準備金		-	4,685
その他利益剰余金		19,052	8,182
繰越利益剰余金		19,052	8,182
株主資本合計		<u>51,452</u>	<u>45,267</u>
その他有価証券評価差額金		9,724	4,338
評価・換算差額等合計		9,724	4,338
純資産の部合計		<u>61,176</u>	<u>49,606</u>
負債及び純資産の部合計		<u>3,302,387</u>	<u>3,399,641</u>



#### 4. 四半期損益計算書

(単位:百万円)

科 目	期 別	平成 24 年度 第 3 四半期累計期間 〔平成 24 年 4 月 1 日から 平成 24 年 12 月 31 日まで〕	平成 25 年度 第 3 四半期累計期間 〔平成 25 年 4 月 1 日から 平成 25 年 12 月 31 日まで〕
		金 額	金 額
経 常 収 益		312,536	544,236
保 険 料 等 収 入		190,518	216,560
（うち保険料）		(181,917)	(204,197)
（うち再保険収入）		(8,601)	(12,362)
資 産 運 用 収 益		112,528	316,382
（うち利息及び配当金等収入）		(14,112)	(16,029)
（うち金銭の信託運用益）		(0)	(0)
（うち有価証券売却益）		(515)	(9,414)
（うち特別勘定資産運用益）		(97,727)	(290,770)
そ の 他 経 常 収 益		9,489	11,293
経 常 費 用		<u>302,325</u>	<u>521,257</u>
保 険 金 等 支 払 金		198,036	344,531
（うち保険金）		(8,151)	(10,013)
（うち年金）		(2,428)	(3,279)
（うち給付金）		(22,934)	(24,121)
（うち解約返戻金）		(104,980)	(235,088)
（うちその他返戻金）		(23,310)	(30,447)
（うち再保険料）		<u>(36,232)</u>	(41,580)
責 任 準 備 金 等 繰 入 額		<u>72,058</u>	<u>141,483</u>
支 払 備 金 繰 入 額		1,424	7,487
責 任 準 備 金 繰 入 額		<u>70,633</u>	<u>133,995</u>
資 産 運 用 費 用		560	1,196
（うち支払利息）		(5)	(10)
（うち有価証券売却損）		(211)	(794)
（うち有価証券評価損）		(11)	(-)
事 業 費		28,904	31,170
そ の 他 経 常 費 用		2,765	2,876
経 常 利 益		<u>10,211</u>	<u>22,978</u>
特 別 利 益		-	12
そ の 他 特 別 利 益		-	12
特 別 損 失		296	282
固 定 資 産 等 処 分 損		60	15
価 格 変 動 準 備 金 繰 入 額		236	266
税 引 前 四 半 期 純 利 益		<u>9,914</u>	<u>22,708</u>
法 人 税 及 び 住 民 税		<u>705</u>	<u>5,467</u>
法 人 税 等 合 計		<u>705</u>	<u>5,467</u>
四 半 期 純 利 益		<u>9,209</u>	<u>17,240</u>

## 注記事項

平成 29 年度において、標準責任準備金の計算方法が誤っていることが判明しました。

当社は問題発覚後、社内において検証を行い、影響が軽微でないことを認識したことから、他に誤りがないか、検証の必要性があると判断し、代表取締役社長を委員長とし、社外有識者を委員とする調査委員会を設立するとともに、社外専門家による調査及び当社社員による自主点検を実施し、責任準備金の算出方法の精査、ならびに責任準備金算出に係る業務プロセス、役割・責任分担、規程及び実務等について、全面的な精査を行いました。

上記の精査を踏まえ、過年度決算において重要な誤謬が存在すると判断し、関連する誤謬を訂正した平成 25 年 3 月期以降 5 期分に係る財務諸表を改めて作成いたしました。

(四半期貸借対照表関係及び株主資本等変動計算書関係)

平成25年度第3四半期会計期間末			
1. 配当金支払額			
平成 25 年 6 月 17 日の定時株主総会において、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			
(イ) 配当金の総額	23,425 百万円		
(ロ) 1 株当たり配当額	72,300 円		
(ハ) 基準日	平成 25 年 3 月 31 日		
(ニ) 効力発生日	平成 25 年 6 月 18 日		
2. 株主資本の金額の著しい変動			
	(単位:百万円)		
	資本金	利益剰余金	株主資本合計
当期首残高	32,400	19,052	51,452
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)	-	※1 △23,425 (-)	△23,425 (-)
四半期純利益	-	17,240	17,240
当第 3 四半期会計期間末までの変動額合計	-	△6,184	△6,184
当第 3 四半期会計期間末残高	32,400	12,867	45,267
※1 平成 25 年 6 月に 23,425 百万円配当しております。 ※2 関連する誤謬を訂正し、計算書類を再作成した結果、当期に実施した剰余金の配当額について、訂正後の当期の分配可能額を超えることとなりました。 <u>しかしながら、当該事実を認識し、株主との間で当該配当金の返還について合意を形成したのが平成 29 年度中であることから、訂正後の当期の株主資本等変動計算書においては、当該配当金に係る訂正は行っておりません。</u>			
3. 金額は記載単位未満を切捨てて表示しております。			

## 注記事項

(四半期損益計算書関係)

平成25年度第3四半期累計期間
1. 1 株当たり四半期純利益は 53,212 円 75 銭であります。
2. 金額は記載単位未満を切捨てて表示しております。

## 5. 経常利益等の明細(基礎利益)

(単位:百万円)

	平成 24 年度 第 3 四半期累計期間	平成 25 年度 第 3 四半期累計期間
基礎利益 A	<u>10,506</u>	<u>15,625</u>
キャピタル収益	516	9,414
金銭の信託運用益	0	0
売買目的有価証券運用益	-	-
有価証券売却益	515	9,414
金融派生商品収益	-	-
為替差益	-	-
その他キャピタル収益	-	-
キャピタル費用	404	1,079
金銭の信託運用損	-	-
売買目的有価証券運用損	-	-
有価証券売却損	211	794
有価証券評価損	11	-
金融派生商品費用	-	-
為替差損	181	285
その他キャピタル費用	-	-
キャピタル損益 B	111	8,335
キャピタル損益含み基礎利益 A+B	<u>10,618</u>	<u>23,961</u>
臨時収益	-	-
再保険収入	-	-
危険準備金戻入額	-	-
個別貸倒引当金戻入額	-	-
その他臨時収益	-	-
臨時費用	<u>406</u>	<u>982</u>
再保険料	-	-
危険準備金繰入額	<u>372</u>	<u>945</u>
個別貸倒引当金繰入額	34	36
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	-	-
臨時損益 C	<u>△406</u>	<u>△982</u>
経常利益 A+B+C	<u>10,211</u>	<u>22,978</u>

## 6. ソルベンシー・マージン比率

(単位:百万円)

項 目	平成 24 年度末	平成 25 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)	<u>117,691</u>	<u>151,230</u>
資本金等	<u>28,026</u>	<u>45,267</u>
価格変動準備金	1,575	1,842
危険準備金	<u>22,918</u>	<u>23,864</u>
一般貸倒引当金	4	1
その他有価証券の評価差額×90%(マイナスの場合100%)	12,644	5,640
土地の含み損益×85%(マイナスの場合100%)	-	-
全期チルメル式責任準備金相当額超過額	<u>68,922</u>	<u>85,002</u>
税効果相当額	-	<u>3,638</u>
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	<u>△16,400</u>	<u>△14,027</u>
控除項目	-	-
その他	-	-
リスクの合計額		
$\sqrt{(R_1 + R_8)^2 + (R_2 + R_3 + R_7)^2} + R_4$ (B)	<u>27,305</u>	<u>24,888</u>
保険リスク相当額 $R_1$	<u>1,773</u>	<u>2,056</u>
第三分野保険の保険リスク相当額 $R_8$	<u>546</u>	<u>705</u>
予定利率リスク相当額 $R_2$	<u>4,167</u>	<u>4,105</u>
資産運用リスク相当額 $R_3$	<u>22,267</u>	<u>19,849</u>
最低保証リスク相当額 $R_7$	<u>191</u>	<u>236</u>
経営管理リスク相当額 $R_4$	578	<u>539</u>
ソルベンシー・マージン比率 $\frac{(A)}{(1/2) \times (B)} \times 100$	<u>862.0%</u>	<u>1,215.2%</u>

(注) 1. 上記は、保険業法施行規則第 86 条、第 87 条、及び平成 8 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  $R_7$  の算出は標準的方式に基づいています。

## (参考)連結ソルベンシー・マージン比率

当社は、子会社であるアイエヌジー・エージェンシー株式会社との連結ソルベンシー・マージン比率を四半期ごとに作成し開示しています。

(単位:百万円)

項 目	平成 24 年度末	平成 25 年度 第 3 四半期 連結会計期間末
ソルベンシー・マージン総額 (A)	<u>117,671</u>	<u>150,982</u>
資本金等	<u>28,016</u>	<u>45,252</u>
価格変動準備金	<u>1,575</u>	<u>1,842</u>
危険準備金	<u>22,918</u>	<u>23,864</u>
一般貸倒引当金	<u>4</u>	<u>1</u>
その他有価証券の評価差額×90%(マイナスの場合100%)	<u>12,644</u>	<u>5,640</u>
土地の含み損益×85%(マイナスの場合100%)	<u>-</u>	<u>-</u>
全期チルメル式責任準備金相当額超過額	<u>68,922</u>	<u>85,002</u>
税効果相当額	<u>-</u>	<u>3,638</u>
負債性資本調達手段等	<u>-</u>	<u>-</u>
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	<u>△16,410</u>	<u>△14,042</u>
控除項目	<u>-</u>	<u>△219</u>
その他	<u>-</u>	<u>-</u>
リスクの合計額		
$\sqrt{(R_1 + R_8)^2 + (R_2 + R_3 + R_7)^2} + R_4$ (B)	<u>27,305</u>	<u>24,817</u>
保険リスク相当額 $R_1$	<u>1,773</u>	<u>2,056</u>
第三分野保険の保険リスク相当額 $R_8$	<u>546</u>	<u>705</u>
予定利率リスク相当額 $R_2$	<u>4,167</u>	<u>4,105</u>
資産運用リスク相当額 $R_3$	<u>22,267</u>	<u>19,779</u>
最低保証リスク相当額 $R_7$	<u>191</u>	<u>236</u>
経営管理リスク相当額 $R_4$	<u>578</u>	<u>537</u>
ソルベンシー・マージン比率 $\frac{(A)}{(1/2) \times (B)} \times 100$	<u>861.8%</u>	<u>1,216.7%</u>

- (注) 1. 上記は、保険業法施行規則第86条の2、第88条及び平成23年金融庁告示第23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  $R_7$  の算出は標準的方式に基づいています。

## 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	平成 24 年度末		平成 25 年度 第 3 四半期会計期間末	
	件 数	金 額	件 数	金 額
個人分割払変額保険及び 個人分割払変額年金保険		10,366		12,912
個人一時払変額保険		10,258		10,352
個人一時払変額年金保険		2,150,617		2,125,044
団 体 年 金 保 険		-		-
特 別 勘 定 計		2,171,242		2,148,308

### (2) 保有契約高

#### ・ 個人分割払変額保険

(単位:千件、百万円)

区 分	平成 24 年度末		平成 25 年度 第 3 四半期会計期間末	
	件 数	金 額	件 数	金 額
個人分割払変額保険(有期型)	0	506	0	494
個人分割払変額保険(終身型)	7	46,749	7	46,742
合 計	7	47,256	7	47,236

#### ・ 個人分割払変額年金保険

(単位:千件、百万円)

区 分	平成 24 年度末		平成 25 年度 第 3 四半期会計期間末	
	件 数	金 額	件 数	金 額
個人分割払変額年金保険	0	1,195	0	1,124

(注) 個人分割払変額年金保険の金額については、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。

#### ・ 個人一時払変額保険

(単位:千件、百万円)

区 分	平成 24 年度末		平成 25 年度 第 3 四半期会計期間末	
	件 数	金 額	件 数	金 額
個人一時払変額保険(終身型)	1	10,226	1	10,340

#### ・ 個人一時払変額年金保険

(単位:千件、百万円)

区 分	平成 24 年度末		平成 25 年度 第 3 四半期会計期間末	
	件 数	金 額	件 数	金 額
個人一時払変額年金保険	371	2,060,069	345	2,113,290

(注) 個人一時払変額年金保険の金額については、年金支払開始前契約の責任準備金(最低保証に係る部分を除く)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。

## 8. 保険会社及びその子会社等の状況

当期においては、子会社等が当社と比べて小規模であり、当企業集団の財政状態、経営成績及びキャッシュ・フローの状況に関する合理的な判断を妨げない程度に重要性が乏しいことから、連結財務諸表を作成していません。

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

【投資状況】

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)

該当ありません。

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
その他のサブプライム・Alt-A エクスポージャー	10,695	253	-
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(※)	10,695	253	-

(※) その他欄には、主に米国住宅市場を投資対象としている外国投資信託を記載しており、Alt-A へのエクスポージャーは全体の約 6.7%です。なお、サブプライムへのエクスポージャーはありません。

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。

以上