

2012年8月10日

## 平成24年度 第1四半期業績のお知らせ

三井住友海上プライマリー生命保険株式会社（本社：東京都中央区、社長：樋口幸男）の平成24年度第1四半期（平成24年4月1日～平成24年6月30日）の業績についてお知らせいたします。

### 【収入保険料】

新しく販売を開始した外貨建定額終身保険の販売好調を背景として、収入保険料は752億円となり、前年同期比37.9%の増加となりました。（グラフ1参照）

### 【契約および総資産の状況】

保有契約件数は454千件と前年度末から2.0%増加しました。一方、保有契約高は、運用環境の悪化により前年度末比4.6%減少し、2兆9,783億円となりました。（グラフ2参照）

また、総資産は、前年度末から3.9%減少し、3兆326億円となりました。

### 【損益の状況】

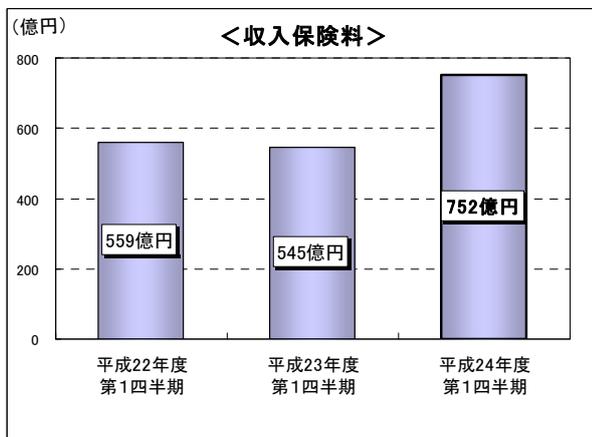
四半期純利益（税引後）は40億円となり、前年同期から3億円減少しました。また、生命保険会社の本業における収益力を示す基礎利益は、前年同期から7億円減少し71億円となりました。

### 【健全性の指標】

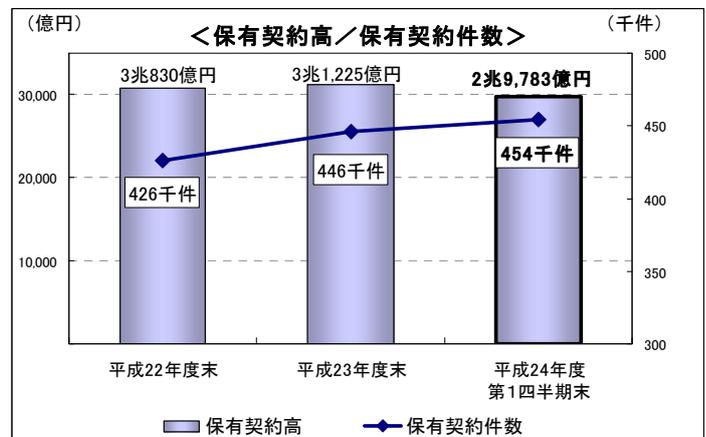
ソルベンシー・マージン比率は768.5%となり、十分な支払余力を維持しています。また、格付会社からは引き続き高い格付けを取得しています（平成24年8月10日現在）。

スタンダード・アンド・プアーズ（S&P）	保険財務力格付け	A+
格付投資情報センター（R&I）	保険金支払能力格付け	AA-

（グラフ1）



（グラフ2）



以上

<b>平成24年度 第1四半期 業績の概要</b>
---------------------------

(単位：件、百万円)

	平成23年度 第1四半期	平成24年度 第1四半期	前年同期比	平成23年度	前年度末比
<b>1. 契約の状況</b>					
新契約件数	9,774	<b>14,262</b>	145.9%	43,069	
新契約高	55,599	<b>71,239</b>	128.1%	237,442	
保有契約件数	430,971	<b>454,980</b>	105.6%	446,053	102.0%
保有契約高	3,062,010	<b>2,978,341</b>	97.3%	3,122,538	95.4%
<b>2. 資産・負債の状況</b>					
総資産	3,054,888	<b>3,032,602</b>	99.3%	3,154,641	96.1%
責任準備金	2,977,729	<b>2,934,427</b>	98.5%	3,067,365	95.7%
資本金および資本準備金	65,795	<b>65,795</b>	100.0%	65,795	100.0%
<b>3. 収支の状況</b>					
収入保険料	54,541	<b>75,229</b>	137.9%	234,793	
保険金・年金・給付金	29,149	<b>35,343</b>	121.2%	141,137	
解約返戻金・その他返戻金	19,720	<b>11,631</b>	59.0%	71,223	
責任準備金繰入額(△戻入額)	△ 18,661	<b>△ 132,938</b>	712.3%	70,974	
資産運用損益	△ 9,258	<b>△ 145,515</b>	1571.8%	94,796	
事業費	4,977	<b>6,290</b>	126.4%	21,554	
税引前当期純利益	6,940	<b>6,382</b>	92.0%	12,369	
法人税等合計	2,517	<b>2,338</b>	92.9%	6,375	
当期純利益	4,423	<b>4,043</b>	91.4%	5,993	
<b>4. 基礎利益の状況</b>					
基礎利益	7,862	<b>7,144</b>	90.9%	28,011	
キャピタル損益	△ 215	<b>237</b>	-	△ 1,984	
臨時損益	△ 556	<b>△ 820</b>	147.5%	△ 13,001	
経常利益	7,090	<b>6,561</b>	92.5%	13,025	
<b>5. ソルベンシー・マージン比率</b>					
ソルベンシー・マージン総額	153,892	<b>193,427</b>		183,140	
リスクの合計額	44,325	<b>50,336</b>		47,226	
ソルベンシー・マージン比率	694.3%	<b>768.5%</b>		775.5%	

## 平成24年度第1四半期報告

三井住友海上プライマリー生命保険株式会社（社長 樋口 幸男）の平成24年度第1四半期（平成24年4月1日～平成24年6月30日）の業績は添付のとおりです。

### <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	……11頁
8. 保険会社及びその子会社等の状況	……11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23年度末		平成24年度 第1四半期会計期間末			
	件 数	金 額	件 数	金 額		
				前年度 末比	前年度 末比	
個 人 保 険	11	1,222	18	161.0	1,542	126.2
個人年金保険	434	30,002	436	100.4	28,240	94.1
団 体 保 険	—	—	—	—	—	—
団体年金保険	—	—	—	—	—	—

(注) 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（ただし、個人変額年金保険については保険料積立金）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23年度 第1四半期累計期間				平成24年度 第1四半期累計期間					
	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	0	3	3	—	7	11909.8	337	9210.9	337	—
個人年金保険	9	552	552	—	6	72.0	375	67.9	375	—
団 体 保 険	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
団体年金保険	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—

(注) 新契約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（ただし、個人変額年金保険については契約時の保険料積立金）です。

## (2) 年換算保険料

### ・保有契約

(単位：百万円、%)

区 分	平成23年度末	平成24年度 第1四半期 会計期間末	
			前年度 末比
個 人 保 険	10,110	12,149	120.2
個 人 年 金 保 険	428,866	423,263	98.7
合 計	438,977	435,413	99.2
うち医療保障・ 生前給付保障等	89	79	89.3

### ・新契約

(単位：百万円、%)

区 分	平成23年度 第1四半期累計期間	平成24年度 第1四半期累計期間	
			前年 同期比
個 人 保 険	31	2,197	7010.7
個 人 年 金 保 険	24,539	24,811	101.1
合 計	24,571	27,008	109.9
うち医療保障・ 生前給付保障等	-	-	-

- (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）、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	平成23年度末		平成24年度 第1四半期会計期間末	
	金 額	占 率	金 額	占 率
現預金・コールローン	14,989	1.9	14,090	1.8
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	646,932	83.1	660,280	82.8
有価証券	95,826	12.3	103,091	12.9
公 社 債	95,803	12.3	103,068	12.9
株 式	-	-	-	-
外 国 証 券	-	-	-	-
公 社 債	-	-	-	-
株 式 等	-	-	-	-
その他の証券	23	0.0	23	0.0
貸付金	689	0.1	692	0.1
不動産	366	0.0	355	0.0
繰延税金資産	10,440	1.3	10,369	1.3
その他	9,124	1.2	8,125	1.0
貸倒引当金	-	-	-	-
合 計	778,368	100.0	797,005	100.0
うち外貨建資産	645,349	82.9	661,010	82.9

## (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23年度末					平成24年度 第1四半期会計期間末				
	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	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
責任準備金対応債券	-	-	-	-	-	23,857	23,968	111	111	-
子会社・関連会社株式	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
その他の有価証券	95,300	95,826	525	529	△3	102,338	103,091	753	757	△3
公 社 債	95,279	95,803	523	527	△3	102,317	103,068	751	755	△3
株 式	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
外 国 証 券	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
公 社 債	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
株 式 等	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
その他の証券	21	23	2	2	-	21	23	2	2	△0
買入金銭債権	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
譲渡性預金	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
そ の 他	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
合 計	95,300	95,826	525	529	△3	126,195	127,060	864	868	△3
公 社 債	95,279	95,803	523	527	△3	102,317	103,068	751	755	△3
株 式	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
外 国 証 券	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
公 社 債	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
株 式 等	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
その他の証券	21	23	2	2	-	21	23	2	2	△0
買入金銭債権	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
譲渡性預金	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
そ の 他	-	-	-	-	-	23,857	23,968	111	111	-

- (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. 金銭の信託のうち売買目的有価証券以外のものを含み、その帳簿価額、差損益は、それぞれ、23,857百万円、111百万円です。

なお、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はありません。

## (3) 金銭の信託の時価情報

(単位：百万円)

区 分	平成23年度末					平成24年度第1四半期会計期間末				
	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	646,932	646,932	-	-	-	660,280	660,391	111	111	-

## ・運用目的の金銭の信託

(単位：百万円)

区 分	平成23年度末			平成24年度第1四半期会計期間末		
	貸借対照表計上額	当期の損益に含まれた 評 価 損 益		貸借対照表計上額	当期の損益に含まれた 評 価 損 益	
運用目的の 金銭の信託	646,932	13,140		636,423	△26,652	

## ・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	平成23年度末					平成24年度第1四半期会計期間末				
	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	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
責任準備金対応の 金 銭 の 信 託	-	-	-	-	-	23,857	23,968	111	111	-
その他の金銭の 信 託	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

### 3. 四半期貸借対照表

(単位: 百万円)

期別 科目	平成23年度 第1四半期会計期間末 (平成23年6月30日現在)	平成24年度 第1四半期会計期間末 (平成24年6月30日現在)	平成23年度末 (平成24年3月31日現在)
	金額	金額	金額
(資産の部)			
現金及び預貯金	8,877	10,187	11,134
預貯金	8,877	10,187	11,134
コーポレート	4,126	4,236	4,271
金銭の信託	585,717	660,280	646,932
有価証券	2,439,956	2,339,803	2,473,269
国債	82,218	103,068	95,803
その他の証券	2,357,738	2,236,735	2,377,466
貸付金	689	692	689
保険約款貸付	689	692	689
有形固定資産	580	1,036	1,047
建物	408	355	366
リース資産	126	645	646
その他の有形固定資産	45	36	34
無形固定資産	1,290	2,629	2,181
ソフトウェア	1,237	2,477	2,034
リース資産	53	151	147
再保険	630	842	1,174
その他の資産	4,759	2,523	3,501
未収金	3,223	1,758	2,856
前払費用	120	-	28
未収収益	45	58	76
預託金	760	181	182
仮払金	608	525	357
繰延税金資産	8,260	10,369	10,440
資産の部合計	3,054,888	3,032,602	3,154,641
(負債の部)			
保険契約準備金	2,984,463	2,941,430	3,075,344
支払準備金	6,734	7,003	7,978
責任準備金	2,977,729	2,934,427	3,067,365
代理店借	880	1,469	1,490
再保険借	1,323	1,329	1,159
その他の負債	8,011	21,534	14,186
未払法人税等	2,517	2,062	8,317
未払金	170	11,622	103
未払費用	997	824	2,149
預り金	225	212	617
リース債務	186	807	802
資産除去債務	154	157	156
仮受金	3,760	5,847	2,039
価格変動準備金	1,409	2,089	1,912
負債の部合計	2,996,088	2,967,852	3,094,092
(純資産の部)			
資本金	41,060	41,060	41,060
資本剰余金	24,735	24,735	24,735
資本準備金	24,735	24,735	24,735
利益剰余金	△7,180	△1,566	△5,609
その他利益剰余金	△7,180	△1,566	△5,609
繰越利益剰余金	△7,180	△1,566	△5,609
株主資本合計	58,614	64,228	60,185
その他有価証券評価差額金	184	521	363
評価・換算差額等合計	184	521	363
純資産の部合計	58,799	64,750	60,549
負債及び純資産の部合計	3,054,888	3,032,602	3,154,641

#### 4. 四半期損益計算書

(単位: 百万円)

科目	期別	平成23年度第1四半期累計期間	平成24年度第1四半期累計期間	平成23年度
		(平成23年4月1日から 平成23年6月30日まで)	(平成24年4月1日から 平成24年6月30日まで)	(平成23年4月1日から 平成24年3月31日まで)
		金額	金額	金額
<b>経常収益</b>		<b>89,093</b>	<b>211,777</b>	<b>344,227</b>
<b>保険料等収入</b>		<b>56,378</b>	<b>77,347</b>	<b>244,879</b>
保険料		54,541	75,229	234,793
再保険収入		1,836	2,118	10,085
<b>資産運用収益</b>		<b>12,756</b>	<b>78</b>	<b>95,655</b>
利息及び配当金等収入		104	78	323
預貯金利息		0	0	4
有価証券利息・配当金		100	73	300
貸付金利息		3	3	15
その他利息配当金		0	0	3
金銭の信託運用益		12,651	-	50,993
特別勘定資産運用益		-	-	44,338
<b>その他経常収益</b>		<b>19,958</b>	<b>134,351</b>	<b>3,693</b>
年金特約取扱受入金		1,260	437	3,652
支払備金戻入額		24	975	-
責任準備金戻入額		18,661	132,938	-
その他の経常収益		11	0	40
<b>経常費用</b>		<b>82,003</b>	<b>205,215</b>	<b>331,202</b>
<b>保険金等支払金</b>		<b>54,787</b>	<b>52,940</b>	<b>235,567</b>
保険金		10,101	10,486	46,439
年金		9,778	10,378	41,180
給付金		9,269	14,478	53,518
解約返戻金		19,513	11,346	70,207
その他の返戻金		206	284	1,015
再保険料		5,917	5,966	23,207
<b>責任準備金等繰入額</b>		<b>-</b>	<b>-</b>	<b>72,193</b>
支払備金繰入額		-	-	1,219
責任準備金繰入額		-	-	70,974
<b>資産運用費用</b>		<b>22,014</b>	<b>145,594</b>	<b>858</b>
支払利息		0	0	0
金銭の信託運用損		-	18,210	-
為替差損		135	250	497
その他運用費用		98	51	360
特別勘定資産運用損		21,780	127,080	-
<b>事業費用</b>		<b>4,977</b>	<b>6,290</b>	<b>21,554</b>
<b>その他経常費用</b>		<b>224</b>	<b>389</b>	<b>1,027</b>
税		122	227	529
減価償却費		100	159	495
その他の経常費用		0	3	3
<b>経常利益</b>		<b>7,090</b>	<b>6,561</b>	<b>13,025</b>
<b>特別損失</b>		<b>149</b>	<b>179</b>	<b>656</b>
固定資産等処分損		0	2	4
価格変動準備金繰入額		149	177	651
<b>税引前四半期(当期)純利益</b>		<b>6,940</b>	<b>6,382</b>	<b>12,369</b>
法人税及び住民税		-	-	8,612
法人税等調整額		-	-	△2,236
法人税等合計		2,517	2,338	6,375
<b>四半期(当期)純利益</b>		<b>4,423</b>	<b>4,043</b>	<b>5,993</b>

## 注記事項

(四半期貸借対照表関係)

### 平成24年度第1四半期会計期間末

1. 会計上の変更  
平成23年度の税制改正に伴い、当第1四半期会計期間より、平成24年4月1日以降に取得した有形固定資産については、改正後の法人税法に基づく減価償却の方法に変更しておりますが、影響額は軽微であります。
2. 四半期特有の会計処理  
税金費用の計算  
税金費用については、主として、税引前四半期純利益に一時差異等に該当しない差異の金額が重要な場合にはその金額を加減した上で法定実効税率を乗じて計算しております。  
なお、法人税等調整額は、「法人税等」に含めて表示しております。
3. 主な金融資産にかかる貸借対照表価額、時価及びこれらの差額については、次の通りであります。

(単位：百万円)

	貸借対照表価額	時価	差額
預貯金	10,187	10,187	—
コールローン	4,236	4,236	—
金銭の信託			
運用目的の金銭の信託	636,423	636,423	—
責任準備金対応の金銭の信託	23,857	23,968	111
有価証券			
売買目的有価証券	2,236,712	2,236,712	—
その他有価証券	103,091	103,091	—

(注)1. 当第1四半期会計期間より、業種別監査委員会報告第21号「保険業における「責任準備金対応債券」に関する当面の会計上及び監査上の取扱い」(日本公認会計士協会平成12年11月16日)に基づく責任準備金対応の金銭の信託を設定しております。

#### 2. 金融商品の時価の算定方法

##### ① 預貯金及びコールローン

預貯金及びコールローンはすべて短期であるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

##### ② 有価証券(金銭の信託において信託財産として運用している有価証券を含む)

・市場価格のある有価証券

6月末日の市場価格等によっております。

4. 1株当たりの純資産額は4,920,587円87銭であります。

## 注記事項

(四半期損益計算書関係)

### 平成24年度第1四半期累計期間

1. 1株当たりの四半期純利益は307,247円11銭であります。なお、潜在株式はありません。

## 5. 経常利益等の明細（基礎利益）

（単位：百万円）

	平成23年度 第1四半期累計期間	平成24年度 第1四半期累計期間	平成23年度
基礎利益 A	7,862	7,144	28,011
キャピタル収益	4,895	26,763	20,023
金銭の信託運用益	4,895	-	20,023
売買目的有価証券運用益	-	-	-
有価証券売却益	-	-	-
金融派生商品収益	-	-	-
為替差益	-	-	-
その他キャピタル収益	-	26,763	-
キャピタル費用	5,111	26,526	22,008
金銭の信託運用損	-	26,275	-
売買目的有価証券運用損	-	-	-
有価証券売却損	-	-	-
有価証券評価損	-	-	-
金融派生商品費用	-	-	-
為替差損	135	250	497
その他キャピタル費用	4,976	-	21,510
キャピタル損益 B	△215	237	△1,984
キャピタル損益含み基礎利益 A+B	7,647	7,382	26,026
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	556	820	13,001
再保険料	-	-	-
危険準備金繰入額	556	820	13,001
個別貸倒引当金繰入額	-	-	-
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	△556	△820	△13,001
経常利益 A+B+C	7,090	6,561	13,025

（注） 1. 基礎利益には、次の金額が含まれております。

	平成23年度 第1四半期累計期間	平成24年度 第1四半期累計期間	平成23年度
金銭の信託運用益のうちインカムゲイン部分	7,756	8,064	30,970
定額年金保険の負債にかかる評価部分調整額	4,976	26,763	21,510

2. その他キャピタル収益には、次の金額が含まれております。

	平成23年度 第1四半期累計期間	平成24年度 第1四半期累計期間	平成23年度
定額年金保険の負債にかかる評価部分調整額	-	26,763	-

3. その他キャピタル費用には、次の金額が含まれております。

	平成23年度 第1四半期累計期間	平成24年度 第1四半期累計期間	平成23年度
定額年金保険の負債にかかる評価部分調整額	4,976	-	21,510

## 6. ソルベンシー・マージン比率

(単位：百万円)

項 目	平成23年度末	平成24年度 第1四半期 会計期間末
ソルベンシー・マージン総額 (A)	183,140	193,427
資本金等	60,185	64,228
価格変動準備金	1,912	2,089
危険準備金	29,236	30,057
一般貸倒引当金	-	-
その他有価証券の評価差額×90% (マイナスの場合100%)	473	678
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	104,209	97,338
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	△ 12,876	△ 963
持込資本金等	-	-
控除項目	-	-
その他	-	-
リスクの合計額	47,226	50,336
$\sqrt{(R_1 + R_8)^2 + (R_2 + R_3 + R_7)^2} + R_4$ (B)		
保険リスク相当額 R1	24	38
第三分野保険の保険リスク相当額 R8	17	17
予定利率リスク相当額 R2	9,866	10,206
最低保証リスク相当額 R7	21,860	22,416
資産運用リスク相当額 R3	14,123	16,245
経営管理リスク相当額 R4	1,376	1,467
ソルベンシー・マージン比率 $\frac{(A)}{(1/2) \times (B)} \times 100$	775.5%	768.5%

- (注) 1. 上記は、保険業法施行規則第86条、第87条、第161条、第162条及び、第190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の算出に際しては、標準的方式を用いております。

(参考) 実質資産負債差額

(単位：百万円)

項 目	平成23年度末	平成24年度 第1四半期 会計期間末
(1) 資産の部に計上されるべき金額の合計額	3,154,641	3,032,713
(2) 負債の部に計上されるべき金額の合計額を基礎として計算した金額	2,958,572	2,838,135
実質資産負債差額 (1) - (2)	196,068	194,577

- (注) 上記は、保険業法第132条第2項に規定する区分等を定める命令および平成11年金融監督庁・大蔵省告示第2号の規定に基づいて算出しております。

## 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23年度末		平成24年度 第1四半期会計期間末	
	件数	金額	件数	金額
個人変額保険		88,499		81,221
個人変額年金保険		2,290,195		2,156,675
団体年金保険		-		-
特別勘定計		2,378,694		2,237,897

### (2) 保有契約高

#### ・個人変額保険

(単位：千件、百万円)

区 分	平成23年度末		平成24年度 第1四半期会計期間末	
	件数	金額	件数	金額
変額保険（有期型）	-	-	-	-
変額保険（終身型）	8	104,847	8	104,120
合 計	8	104,847	8	104,120

#### ・個人変額年金保険

(単位：千件、百万円)

区 分	平成23年度末		平成24年度 第1四半期会計期間末	
	件数	金額	件数	金額
個人変額年金保険	312	2,294,491	314	2,161,662
合 計	312	2,294,491	314	2,161,662

## 8. 保険会社及びその子会社等の状況

該当ありません。

(添付)

2012年8月10日

三井住友海上プライマリー生命保険株式会社

## 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月末時点について、金融安定化フォーラム（FSF）の報告書に示された先進的開示例に基づき、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開示いたします。

なお、以下に記載の実現損益は、平成24年4月～平成24年6月の損益です。

### 【投資状況】

1. 特別目的事業体（SPEs）一般

特別目的事業体（SPEs）への投資はありません。

2. 債務担保証券（CDO）一般

債務担保証券（CDO）への投資はありません。

3. その他のサブプライム・Alt-A エクスポージャー

サブプライム・Alt-A エクスポージャーを裏付資産とした証券化商品等への投資はありません。

4. 商業用不動産担保証券（CMBS）

(単位：億円)

	格付	時 価		含み損益	実現損益
			参考:平成24年3月末		
商業用不動産担保証券（CMBS）		123.5	129.7	—	△4.6
日本		—	—	—	—
米国		123.5	129.7	—	△4.6
	AAA	92.6	97.8	—	△3.7
	AA	10.3	10.7	—	△0.3
	A	20.6	21.3	—	△0.7
	BBB以下	—	—	—	—
欧州		—	—	—	—
豪州		—	—	—	—
	AAA	—	—	—	—
	AA	—	—	—	—
	A	—	—	—	—
	BBB以下	—	—	—	—
その他		—	—	—	—

- 裏付資産は米国の商業用不動産（オフィス、商業施設、倉庫、賃貸住宅、ホテル等）です。
- 上記は売買目的有価証券に区分しているため、評価損益はすべて実現損益に含まれますので、含み損益はありません。なお、上記の実現損益のうち、当年度の現地通貨ベースでの評価損益は0.0億円、為替の変動に係る評価損益は△4.7億円です。（当該資産は外貨建て定額年金保険に対応する運用資産の一部であり、ALM上、資産側と負債側の通貨をマッチングさせていることから為替に係る評価損益は相殺される構造となっており、当年度損益への大きな影響はありません。）

## 5. レバレッジド・ファイナンス

レバレッジド・ファイナンスへの投資はありません。

## 6. その他

(単位：億円)

	格付	時 価		含み損益	実現損益
			参考：平成24年3月末		
その他		87.8	94.1	—	△5.4
ABS (カードローン・自動車ローン担保等)		80.0	85.7	—	△4.8
	AAA	80.0	85.7	—	△4.8
	AA	—	—	—	—
	A	—	—	—	—
	BBB以下	—	—	—	—
MBS (住宅ローン担保等)		7.8	8.4	—	△0.6
	AAA	7.8	8.4	—	△0.6

- サブプライムローン関連のエクスポージャーはありません。
- 上記は売買目的有価証券に区分しているため、評価損益はすべて実現損益に含まれますので、含み損益はありません。なお、上記の実現損益のうち、当年度の現地通貨ベースでの評価損益は△0.2億円、為替の変動に係る評価損益は△5.2億円です。(当該資産は外貨建て定額年金保険に対応する運用資産の一部であり、ALM上、資産側と負債側の通貨をマッチングさせていることから為替に係る評価損益は相殺される構造となっており、当年度損益への大きな影響はありません。)

※上記の時価の金額は、当社の貸借対照表上の「金銭の信託」に含まれている金額です。

※上記の実現損益の金額は、当社の損益計算書上の「金銭の信託運用益」に含まれている金額です。

※投資信託については開示対象から除いております。

以 上