

FSF報告書における先進的開示事例を踏まえた我が国の預金取扱金融機関の証券化商品等の保有額等について

(平成20年3月末時点)(単位:10億円)

	サブプライム関連商品等保有額												CLO,CDO※			RMBS※			CMBS			レバレッジドローン		合計		
	うちCDO			うちRMBS			その他			小計			保有額	評価損益	実現損益 (売却損益・減損等)	保有額	評価損益	実現損益 (売却損益・減損等)	保有額	評価損益	実現損益 (売却損益・減損等)	保有額	実現損益 (売却損益・減損等)	保有額	評価損益	実現損益 (売却損益・減損等)
	保有額	評価損益	実現損益 (売却損益・減損等)	保有額	評価損益	実現損益 (売却損益・減損等)	保有額	評価損益	実現損益 (売却損益・減損等)	保有額	評価損益	実現損益 (売却損益・減損等)														
大手行等	246	▲ 24	▲ 528	513	▲ 99	▲ 70	174	0	▲ 53	933	▲ 123	▲ 652	6,164	▲ 573	▲ 328	3,988	▲ 66	▲ 191	2,338	▲ 71	▲ 10	5,178	▲ 64	18,602	▲ 833	▲ 1,243
													5,632	▲ 559	▲ 309	1,057	▲ 69	▲ 192	590	▲ 63	▲ 9	4,031	▲ 62	12,243	▲ 813	▲ 1,224
地域銀行	11	▲ 1	▲ 46	0	▲ 0	0	43	▲ 1	0	54	▲ 1	▲ 46	340	▲ 34	▲ 84	1,030	▲ 0	14	457	▲ 2	4	17	0	1,897	▲ 37	▲ 111
													246	▲ 31	▲ 83	1	▲ 0	▲ 0	-	-	▲ 0	5	0	306	▲ 32	▲ 128
協同組織 金融機関	4	▲ 0	▲ 30	0	▲ 0	0	28	▲ 1	1	32	▲ 1	▲ 28	1,261	▲ 111	▲ 82	762	▲ 0	9	222	▲ 1	3	16	0	2,294	▲ 113	▲ 98
													925	▲ 101	▲ 82	-	-	-	-	-	-	-	-	958	▲ 102	▲ 110
合計	261	▲ 24	▲ 604	513	▲ 99	▲ 70	245	▲ 1	▲ 51	1,019	▲ 125	▲ 725	7,766	▲ 718	▲ 495	5,780	▲ 67	▲ 167	3,017	▲ 74	▲ 2	5,211	▲ 63	22,793	▲ 983	▲ 1,453
													6,803	▲ 691	▲ 474	1,058	▲ 69	▲ 192	590	▲ 63	▲ 9	4,036	▲ 61	13,507	▲ 947	▲ 1,462

(参考) 商品別毀損率	▲ 70.83%	▲ 28.19%	▲ 22.35%	▲ 48.33%	▲ 14.40%	▲ 3.90%	▲ 2.75%	▲ 1.22%	▲ 9.79%
					▲ 15.68%	▲ 19.09%	▲ 11.86%	▲ 1.53%	▲ 15.56%

点線枠内は原資産が海外の計数。

※サブプライム関連のCDO、RMBSは含まれない。

(注1)「商品別毀損率」については、評価損益(3月末)と引当及び減損(3月期)の合計を、減損前保有額にて割ったものとして算出。

(注2)上記はヒアリングベースの計数であり、今後、各行等の精査の中で変動しうる。

(注3)CDOには、CDO等へ投資を行っているSIVを含む。

(注4)RMBSには政府支援機関等のモーゲージ債は含まない。

(注5)レバレッジドローンとは、各金融機関によりその定義は若干異なるが、一般的には、企業買収に際して供与されるローン等の低格付企業向けローンを指す。

(注6)上記のほか一部の銀行において、モノライン保険会社を相手方とするCDS取引による損失(約▲300億円)が公表されている。