

# 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22年6月末時点)

※下段( )書きは平成22年3月末の数値 (単位:10億円)

	サブプライム関連商品等保有額									CLO,CDO <sup>※</sup>			RMBS <sup>※</sup>			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	16	8	▲ 642	152	7	▲ 229	132	▲ 2	▲ 87	300	13	▲ 958	3,533	▲ 93	▲ 725	2,532	19	▲ 337	1,468	▲ 42	▲ 100	3,927	▲ 124	11,759	▲ 103	▲ 2,244
	(23)	(9)	(▲ 630)	(167)	(▲ 1)	(▲ 227)	(135)	(▲ 3)	(▲ 87)	(325)	(5)	(▲ 944)	(4,038)	(▲ 103)	(▲ 719)	(2,774)	(2)	(▲ 339)	(1,598)	(▲ 43)	(▲ 88)	(4,087)	(▲ 127)	(12,821)	(▲ 139)	(▲ 2,217)
地域銀行	0	0	▲ 49	0	0	0	16	▲ 2	▲ 5	16	▲ 2	▲ 54	64	2	▲ 193	683	▲ 1	34	262	▲ 10	4	18	0	1,044	▲ 11	▲ 209
	(0)	(0)	(▲ 49)	(0)	(0)	(0)	(19)	(▲ 2)	(▲ 4)	(19)	(▲ 2)	(▲ 54)	(71)	(2)	(▲ 195)	(713)	(▲ 4)	(32)	(275)	(▲ 10)	(4)	(19)	(0)	(1,097)	(▲ 14)	(▲ 212)
協同組織 金融機関	0	▲ 0	▲ 30	0	0	0	10	▲ 0	▲ 3	10	▲ 0	▲ 33	760	8	▲ 166	614	▲ 1	27	130	▲ 4	6	15	1	1,529	3	▲ 165
	(0)	(▲ 0)	(▲ 31)	(0)	(0)	(0)	(12)	(▲ 0)	(▲ 3)	(12)	(▲ 0)	(▲ 35)	(836)	(13)	(▲ 167)	(644)	(▲ 2)	(26)	(132)	(▲ 4)	(6)	(15)	(1)	(1,638)	(7)	(▲ 169)
合計	16	8	▲ 721	152	7	▲ 229	159	▲ 4	▲ 95	327	11	▲ 1,045	4,356	▲ 83	▲ 1,084	3,829	16	▲ 276	1,860	▲ 56	▲ 90	3,960	▲ 123	14,332	▲ 112	▲ 2,618
	(23)	(9)	(▲ 711)	(167)	(▲ 1)	(▲ 227)	(166)	(▲ 5)	(▲ 95)	(355)	(3)	(▲ 1,033)	(4,944)	(▲ 88)	(▲ 1,081)	(4,130)	(▲ 4)	(▲ 281)	(2,005)	(▲ 57)	(▲ 78)	(4,121)	(▲ 126)	(15,556)	(▲ 146)	(▲ 2,598)
(参考) 商品別毀損率	▲ 96.18%			▲ 52.53%			▲ 32.08%			▲ 72.04%			▲ 18.20%			▲ 5.62%			▲ 8.04%			▲ 2.28%		▲ 13.91%		
	(▲95.06%)			(▲52.24%)			(▲31.50%)			(▲70.91%)			(▲17.00%)			(▲5.64%)			(▲7.04%)			(▲2.31%)		(▲13.10%)		
	▲ 19.41%			▲ 35.72%			▲ 14.03%			▲ 2.33%			▲ 19.41%			▲ 35.72%			▲ 14.03%			▲ 2.33%		▲ 22.01%		
	(▲17.75%)			(▲29.86%)			(▲12.51%)			(▲2.32%)			(▲17.75%)			(▲29.86%)			(▲12.51%)			(▲2.32%)		(▲20.18%)		

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(6月末)と引当及び減損(19年4月からの累計)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得る。

(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(わが国の住宅金融支援機構を含む)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▲440億円)が公表されている。