

我が国の預金取扱金融機関のサブプライム関連商品の保有額等について (平成20年12月末時点)

※下段()書きは平成20年9月末の数値 (単位:10億円)

| | Tier1自己資本 (20年3月末) | 実質業純 (20年3月期) | 株式評価益 (20年12月末) | サブプライム関連商品等保有額 | | | | | | サブプライム関連の ABCPプログラム |
|--------------|-----------------------|------------------|--------------------|----------------|----------------|--|----------------|----------|--|------------------------|
| | | | | サブプライム関連商品等保有額 | | | うちサブプライム関連ビジネス | | | エクスポージャー |
| | | | | 簿価 (12月末) | 評価損益 | 実現損益 (売却損益・減損等 (19年4月からの 累計)) | 簿価 (12月末) | 評価損益 | 実現損益 (売却損益・減損等 (19年4月からの累 計)) | |
| 大手行等 | 25,987 | 3,499 | 111 (2,201) | 496 (719) | ▲119 (▲140) | ▲842 (▲727) | 21 (26) | 0 (0) | ▲317 (▲316) | — |
| 地域銀行 | 12,862 | 1,799 | 666 (1,620) | 39 (46) | ▲7 (▲3) | ▲48 (▲47) | — | — | — | — |
| 協同組織 金融機関 | 11,222 | 795 | ▲327 (▲132) | 30 (31) | ▲8 (▲4) | ▲29 (▲29) | — | — | — | — |
| 合計 | 50,071 | 6,093 | 450 (3,690) | 565 (797) | ▲134 (▲147) | ▲919 (▲803) | 21 (26) | 0 (0) | ▲317 (▲316) | — |

※この他、サブプライムローンと直接係わりのない証券化商品等についても、グローバルな金融市場の混乱の影響が欧米を中心として広範に及んでおり、我が国の一部金融機関において、一定程度の評価損や実現損が発生しているものがある。

(注1)「サブプライム関連商品等」とは、サブプライムローンを原資産とする ABS 及びそうした ABS を原資産に含む CDO などの金融商品等を指す。なお、投資信託の運用の中で、結果的にサブプライム関連商品への投資が行われているものは含まれていない。

「サブプライム関連ビジネス」とは、サブプライムローン関連商品の組成ビジネス等を指す。

(注2)「大手行等」には、主要行、農林中央金庫、新生銀行、あおぞら銀行、シティバンク銀行、新たな形態の銀行、外銀信託等が含まれている。

(注3)「協同組織金融機関」には、信金中央金庫を含む信用金庫、全国信用協同組合連合会を含む信用組合、労働金庫連合会を含む労働金庫、信農連、信漁連が含まれている。農業協同組合等は含まれていない。なお、農林中央金庫は大手行等に含まれている。

(注4)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5)一部の証券会社のサブプライム関連商品等保有額が、連結される大手行等に含まれている。