

「証券化市場の動向調査」（2005年5月公表分）（注）

【本資料をご覧になる方へのお知らせ（必ずお読みください）】

1. 本資料は、証券化商品のアレンジャー、格付機関などの報告者から任意に報告を受けた個別の証券化商品に関する情報を掲載したものです。
2. 本資料は、証券化市場全体の実勢の把握に資することを目的として作成されたものであり、日本銀行として、本資料に掲載されている個別の証券化商品への投資を推奨・勧誘するものではありません。また、市場において個別の証券化商品の発行時に設定される条件の目安を示すものでもありません。
3. 本資料の作成に当たっては、信頼し得ると判断した報告者から報告を受けていますが、報告者は、日本銀行に報告する事項について、正確性を保証する責任は負っていません。また、本資料の内容について、日本銀行として、正確性を保証するものではありません。なお、掲載されている個別の商品にかかる情報は、本資料の「基準日」欄に記載されている日付現在のものであり、格付の変更など、その後変化している可能性があります。

（注）本調査は、日本国内に所在する特定資産を主たる裏付資産として、2004年4月1日以降に発行された債券、信託受益権、C P（短期社債等、短期外債を含みます）を対象としています（証券化商品プログラムの下で発行されるものを除きます）。また、本資料は、日本銀行が、2005年4月14日から5月17日の間に報告を受けたものを取りまとめています。

| 発行日<br>（条件決定日）             | 案件（発行者）名  | オリジネーター           | アレンジャー等              | 発行形式    | 裏付資産                             | トランチ  | 発行金額<br>（億円） | 予定 /<br>平均年限 | 法定最終償還日    | 償還方法                                 | 格 付   |     |         |      |     | クーポン | ｽﾌﾟﾚｯﾄ* | 基準金利          | 基準日        |
|----------------------------|---|-------------------|----------------------|---------|----------------------------------|-------|--------------|--------------|------------|--------------------------------------|-------|-----|---------|------|-----|------|---------|---------------|------------|
|                            |   |                   |                      |         |                                  |       |              |              |            |                                      | Fitch | JCR | Moody's | R&I  | S&P |      |         |               |            |
| 2005年4月20日<br>(2005年4月18日) | 小口手形債権一括流動化<br>ﾌﾞﾛｸﾞ ｽﾌﾟﾘﾊﾞ優先受益権<br>05-04-01-01 | 広島銀行取引先           | 広島銀行<br>みずほ信託銀行（受託者） | 信託受益権   | 商業手形                             | 優先受益権 | 2            | 2ヶ月          | 2005年7月5日  | ﾊｰﾄﾞﾌﾞﾚｯﾄ                            | -     | -   | -       | a-1+ | -   | -    | -       | -             | 2005年4月28日 |
| 2005年4月20日<br>(2005年4月18日) | 小口手形債権一括流動化<br>ﾌﾞﾛｸﾞ ｽﾌﾟﾘﾊﾞ優先受益権<br>05-04-01-02 | 広島銀行取引先           | 広島銀行<br>みずほ信託銀行（受託者） | 信託受益権   | 商業手形                             | 優先受益権 | 4            | 3ヶ月          | 2005年8月4日  | ﾊｰﾄﾞﾌﾞﾚｯﾄ                            | -     | -   | -       | a-1+ | -   | -    | -       | -             | 2005年4月28日 |
| 2005年4月20日<br>(2005年4月18日) | 小口手形債権一括流動化<br>ﾌﾞﾛｸﾞ ｽﾌﾟﾘﾊﾞ優先受益権<br>05-04-01-03 | 広島銀行取引先           | 広島銀行<br>みずほ信託銀行（受託者） | 信託受益権   | 商業手形                             | 優先受益権 | 2            | 4ヶ月          | 2005年9月5日  | ﾊｰﾄﾞﾌﾞﾚｯﾄ                            | -     | -   | -       | a-1+ | -   | -    | -       | -             | 2005年4月28日 |
| 2005年4月20日<br>(2005年4月18日) | 東リ・リック手形債権<br>信託受益権05-04                        | 東リ（株）<br>・リック（株）  | ＵＦＪ信託銀行              | 信託受益権   | 商業手形                             | 優先受益権 | 10           | 106日         | 2005年8月4日  | ﾊｰﾄﾞﾌﾞﾚｯﾄ                            | -     | -   | -       | a-1+ | -   | -    | -       | -             | 2005年5月10日 |
| 2005年4月25日<br>(2005年4月11日) | クレア・セブン特定目的会社                                   | オリエント<br>コーポレーション | みずほ証券                | 国内私募債   | 信託受益権<br>（カードローン債権及び<br>クレジット債権） | A     | 211          | 2.03年        | 2011年4月14日 | 1年後から<br>1ヶ月毎ｺﾝﾄﾘﾌﾞｰﾄﾞ<br>・ﾌｪｲﾄﾞｰｼｮﾝ | -     | -   | Aaa     | -    | AAA | -    | -       | -             | 2005年4月28日 |
|                            |   |                   |                      |         |                                  | B     | 39           | 2.03年        | 2011年4月14日 | 1年後から<br>1ヶ月毎ｺﾝﾄﾘﾌﾞｰﾄﾞ<br>・ﾌｪｲﾄﾞｰｼｮﾝ | -     | -   | Baa2    | -    | BBB | -    | -       | -             | 2005年4月28日 |
| 2005年4月27日<br>(2005年4月20日) | ﾈｰﾎｰﾝ・ﾋﾞｼﾞﾈｽ・ﾌｧﾝﾃﾞｨﾝｸﾞ                          | 新生銀行              | 新生銀行                 | サムライ私募債 | 信託受益権                            | A     | 169          | 2.88年        | 2011年4月18日 | 1ヶ月毎ﾊﾞｽｽﾄｰ                           | -     | -   | Aaa     | -    | AAA | -    | -       | -             | 2005年4月27日 |
|                            |   |                   |                      |         |                                  | M     | 30           | 3.88年        | 2011年4月18日 | 1ヶ月毎ﾊﾞｽｽﾄｰ                           | -     | -   | Baa2    | -    | BBB | -    | -       | -             | 2005年4月27日 |
| 2005年4月27日<br>(2005年4月21日) | ﾋﾞｼﾞﾈｽ・ﾌｧﾝﾃﾞｨﾝｸﾞ<br>特定目的会社                      | エイワ               | 新生銀行                 | 国内私募債   | 信託受益権<br>（消費者ローン債権）              | -     | 102          | 4.41年        | 2012年1月16日 | 1ヶ月毎ﾊﾞｽｽﾄｰ                           | -     | -   | Aa2     | -    | -   | -    | 0.70%   | 1ヶ月<br>円LIBOR | 2005年4月27日 |
| 2005年4月28日<br>(2005年4月26日) | 手形債権流動化ﾌﾞﾛｸﾞ ｽﾌﾟﾘ<br>日発販売受益権信託受益権<br>05-02-01   | 日発販売              | みずほ信託銀行              | 信託受益権   | 信託受益権<br>（商業手形）                  | 優先受益権 | 4            | 2ヶ月          | 2005年7月4日  | ﾊｰﾄﾞﾌﾞﾚｯﾄ                            | -     | -   | -       | a-1+ | -   | -    | -       | -             | 2005年4月28日 |
| 2005年4月28日<br>(2005年4月26日) | 手形債権流動化ﾌﾞﾛｸﾞ ｽﾌﾟﾘ<br>日発販売受益権信託受益権<br>05-03-01   | 日発販売              | みずほ信託銀行              | 信託受益権   | 信託受益権<br>（商業手形）                  | 優先受益権 | 6            | 3ヶ月          | 2005年8月3日  | ﾊｰﾄﾞﾌﾞﾚｯﾄ                            | -     | -   | -       | a-1+ | -   | -    | -       | -             | 2005年4月28日 |
| 2005年4月28日<br>(2005年4月26日) | 手形債権流動化ﾌﾞﾛｸﾞ ｽﾌﾟﾘ<br>日発販売受益権信託受益権<br>05-04-01   | 日発販売              | みずほ信託銀行              | 信託受益権   | 信託受益権<br>（商業手形）                  | 優先受益権 | 3            | 4ヶ月          | 2005年9月2日  | ﾊｰﾄﾞﾌﾞﾚｯﾄ                            | -     | -   | -       | a-1+ | -   | -    | -       | -             | 2005年4月28日 |
| 2005年5月2日<br>（ - ）         | NRF Trust 2005-1                                | -                 | -                    | -       | -                                | 1     | 92.537       | -            | 2039年      | -                                    | -     | -   | -       | -    | AAA | -    | -       | -             | 2005年5月2日  |
|                            |   |                   |                      |         |                                  | 2     | 92.537       | -            | 2039年      | -                                    | -     | -   | -       | -    | AAA | -    | -       | -             | 2005年5月2日  |

| 発行日<br>(条件決定日)             | 案件(発行者)名               | オリジネーター | アレンジャー等                             | 発行形式  | 裏付資産    | トランチ      | 発行金額<br>(億円)  | 予定/<br>平均年限 | 法定最終償還日    | 償還方法   | 格 付   |     |         |     |     | クーポン  | スプレッド | 基準金利              | 基準日        |
|----------------------------|------------------------|---------|-------------------------------------|-------|---------|-----------|---------------|-------------|------------|--------|-------|-----|---------|-----|-----|-------|-------|-------------------|------------|
|                            |                        |         |                                     |       |         |           |               |             |            |        | Fitch | JCR | Moody's | R&I | S&P |       |       |                   |            |
| 2005年5月10日<br>( - )        | 日立キャピタル住宅ローン<br>信託受益権  | -       | -                                   | -     | -       | -         | -             | -           | 2035年8月    | -      | -     | -   | -       | -   | AAA | -     | -     | -                 | 2005年5月10日 |
| 2005年5月12日<br>(2005年4月20日) | 貸付債権担保第30回<br>住宅金融公庫債券 | 住宅金融公庫  | 大和証券SMBC(事務主幹事)<br>UFJつばさ証券<br>三菱証券 | 国内公募債 | 住宅ローン債権 | -         | 966           | -           | 2040年5月10日 | 1ヶ月毎元金 | -     | -   | -       | AAA | AAA | 1.67% | 0.38% | 1.29%<br>JGB269回債 | 2005年5月12日 |
| 2005年5月13日<br>(2005年4月22日) | JLOC XXIV信託            | -       | モルガン・スタンレー証券会社<br>ドイチェ信託銀行          | 信託受益権 | 商業用不動産  | A         | 188           | 4.9年        | 2014年5月15日 | -      | AAA   | -   | Aaa     | -   | AAA | -     | 0.20% | 3ヶ月<br>円LIBOR     | 2005年5月17日 |
|                            |                        |         |                                     |       |         | B         | 22            | 5.8年        | 2014年5月15日 | -      | AA    | -   | Aa2     | -   | AA  | -     | 0.40% | 3ヶ月<br>円LIBOR     | 2005年5月17日 |
|                            |                        |         |                                     |       |         | C         | 18            | 5.6年        | 2014年5月15日 | -      | A     | -   | A2      | -   | A   | -     | 0.62% | 3ヶ月<br>円LIBOR     | 2005年5月17日 |
|                            |                        |         |                                     |       |         | X<br>(IO) | 228<br>(想定元本) | -           | -          | -      | AAA   | -   | Aaa     | -   | AAA | -     | -     | -                 | 2005年5月17日 |

以 上