

地域金融機関CLO シンセティック型（合同会社たんぽぽ2008）発行要項

以下は、「地域金融機関CLO シンセティック型（合同会社たんぽぽ2008）」に係るCLOの内容です。

発行金額 (格付：R&I/Moody`s)	A号無担保社債 25,400百万円（AAA / Aaa） B号無担保社債 800百万円（A / A1）
利率（年率）	A号無担保社債 TIBOR+0.65%
発行予定日	平成20年3月14日
予定償還期日 (最終償還期日)	平成23年3月31日 (平成23年5月31日)
利払日	3ヵ月毎（毎年3月、6月、9月、12月。） (当該期日が営業日でない場合は、その翌営業日。)
償還方法	初回を平成20年6月20日とし、毎年3月、6月、9月及び12月に順次償還。 (当該期日が営業日でない場合は、その翌営業日。) パススルー (A号無担保社債、B号無担保社債の割合に応じたプロラタ償還)
参照プールの概要	地域金融機関CLO シンセティック型（合同会社たんぽぽ2008）参加金融機関が募集した中小企業向け貸付債権（無担保・第三者保証なし）1,193件（1,182社）／当初総額：295.18億円 ※デフォルト確率（加重平均） CRD（モデルⅢ）0.51% ／ RDB（SME）0.70% ／ リスクカルク（v3.1）0.46%
裏付け資産	クレジットデフォルトスワップ契約、預金
参加金融機関 (オリジネーター／ バイヤー)	みちのく銀行、東北銀行、広島銀行、阿波銀行、静岡中央銀行、中京銀行、トマト銀行、仙南信用金庫、飯能信用金庫、朝日信用金庫、亀有信用金庫、足立成和信用金庫、西京信用金庫、西武信用金庫、長野信用金庫、金沢信用金庫、桑名信用金庫、大阪信用金庫、※熊本第一信用金庫、※熊本中央信用金庫、茨城県信用組合、長野県信用組合 ※「平成19年度熊本県CLO」参加金融機関 (7銀行、13信用金庫、2信用組合。金融機関コード順)
セラー	合同会社たんぽぽ2008
独立認定人	新日本監査法人
発行代わり金預入銀行	参加金融機関の普通預金（無利息）口座（決済用預金）
社債管理者	みずほコーポレート銀行
私募の取扱者	大和証券SMBC