



## 【パフォーマンスレポート】

公表日：2011年11月30日

## 地域金融機関平成18年9月CLO

ストラクチャードファイナンス本部

## 【最終結果】

2011年10月17日に優先受益権およびメザニン受益権の元本を全額償還した。発行日（2006年9月27日）から2011年9月20日までの期間（計算期間）における裏付資産の累積デフォルト債権の発生率は約6.19%、発生件数は34件であった。

## 【格付対象】

信託の名称	地域金融機関平成18年9月CLO		
金額	優先受益権 0円（当初：10,500,000,000円） メザニン受益権 0円（当初：250,000,000円）		
委託者	日本政策金融公庫		
オリジネーター	神奈川銀行、愛媛銀行、熊本ファミリー銀行、福井信用金庫、碧海信用金庫、尾西信用金庫、長浜信用金庫、米子信用金庫、日本政策金融公庫		
受託者	みずほ信託銀行		
信託受益権販売業者	大和証券キャピタル・マーケット		
裏付資産	平成18年9月CLOのオリジネーターが募集した中小企業向け貸付債権		
信託設定日	2006年9月27日		
予定最終償還日	2011年10月17日		
法定最終償還日	2012年10月15日		
償還方法	コントロールド・アモチゼーション （優先受益権、メザニン受益権の割合に応じたプロラタ償還）		
信用補完	優先劣後構造		
	償還時の格付	発行時の格付	個別信用補完
優先受益権	AAA	AAA	メザニン受益権、シニア劣後受益権、 ジュニア劣後受益権
メザニン受益権	AAA	AA	シニア劣後受益権、ジュニア劣後受益 権
備考	格付は、法定最終償還日までに優先受益権、メザニン受益権の元本が全額支払われ、期日通りに配当される可能性を評価している。		

## 【裏付資産の状況】

	2006/9/27	2011/9/20
債権元本残高	12,053,000,000 円	317,017,785 円
元本残高率	100%	2.63%
延滞債権元本金額	0 円	0 円
延滞率	0%	0%
長期延滞債権元本金額	0 円	0 円
長期延滞率	0%	0%
累積デフォルト債権元本金額	0 円	746,421,154 円
累積デフォルト率	0%	6.19%
債務者数	338 社	17 社

元本残高率：計算期間末日の元本残高／当初債権元本残高

延滞債権元本金額：計算期間末日時点で3カ月未満の延滞である債権の元本金額

延滞率：計算期間末日の延滞債権元本金額／計算期間末日の債権元本残高

長期延滞債権元本金額：計算期間末日時点で3カ月以上延滞である債権の元本金額

長期延滞率：計算期間末日の長期延滞債権元本金額／計算期間末日の債権元本残高

累積デフォルト債権元本金額：計算期間末日時点のデフォルト債権の累計元本金額

累積デフォルト率：計算期間末日の累積デフォルト債権元本金額／当初債権元本残高

デフォルト債権：デフォルト債権は以下のいずれかに該当するものをいう。

- ①原債務者に金銭消費貸借契約に定める「期限の利益の当然喪失事由」に該当する事由が生じたもの
- ②原債務者に金銭消費貸借契約に定める「期限の利益の請求喪失事由」に該当する事由が生じ、かつ請求通知により期限の利益を喪失したもの

当サービスは、金融商品取引法にて定める信用格付業の業務ではありません。

信用格付は、発行体が負う金融債務についての総合的な債務履行能力や個々の債務等が約定通りに履行される確実性（信用力）に対する R&I の意見であり、事実の表明ではありません。また、R&I は、信用リスク以外のリスクにつき意見を表明するものではなく、投資判断や財務に関する助言や、投資の是非等の推奨をするものではありません。R&I は、信用格付に際し関連情報の正確性等につき独自の検証を行っておらず、これに関し何ら表明も保証もいたしません。R&I は、信用格付（変更・取り下げ等を含む）に関連して発生する損害等につき、何ら責任を負いません。信用格付は、原則として発行体から対価を受領して実施したものです。なお、詳細につき <http://www.r-i.co.jp/jpn/policy/policy.html> をご覧ください。

## 株式会社格付投資情報センター

Copyright(C) 2011 Rating and Investment Information, Inc. All rights reserved.

〒103-0027 東京都中央区日本橋 1-4-1 日本橋一丁目ビルディング（お問い合わせ）インベスターズ・サービス本部 TEL 03-3276-3511

当サイト、当サイトの内容その他サイトに含まれる情報に関する一切の権利・利益（著作権その他の知的財産権及びノウハウを含みます）は、特段の記載がない限り、株式会社格付投資情報センター（以下「R&I」といいます）に帰属します。R&I の事前の書面による許諾無く、これらの情報等の全部又は一部を使用（複製、改変、送信、頒布、譲渡、貸与、翻訳及び翻案等を含みます）し、又は使用する目的で保管することは禁止されています。