

シンセティックCBO「第2回わかば」発行後情報開示サマリー(平成18年1月4日時点)

1. 発行後の継続情報開示

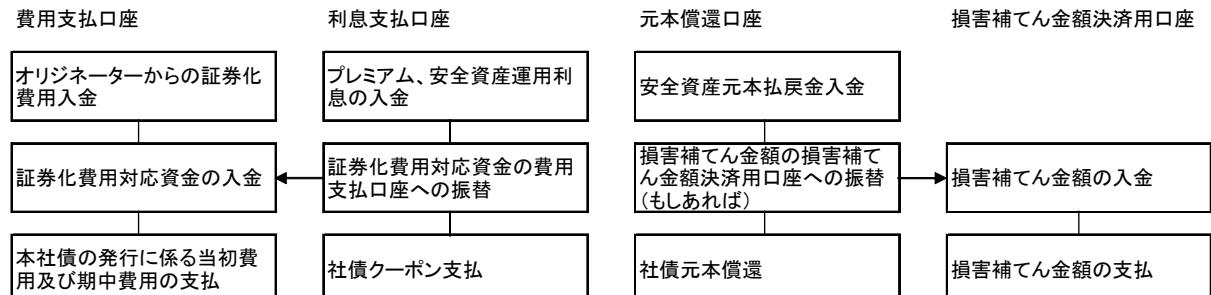
(1) 発行の概要

項目	トランチA号	トランチn号
発行証券総残高	17,800,000,000 (免責金額2,105,000,000(10.58%))	(円)
利率(配当率)	3ヶ月Tibor+17bp (Long First Coupon 5ヶ月Tibor+17bp)	(%)
レベル1 予定償還日または 予定償還スケジュール	【当初どおり変更なし】 ・初回を2006/8/23とし、以降、毎年8月及び11月 に順次償還(休日翌営業日) ・平均年限(クレジットイベント、延滞が発生しない 場合)	
	2.40年	
格付(維持、変更等)情報	【当初どおり変更なし】 Moody's/Aaa、R&I/AAA	

(2) ストラクチャー、関係者概要

項目	開示内容
レベル1 主な関係者の情報 オリジネーター・サービス	(名称) 中小企業金融公庫
	(組織) 主務大臣、経済産業大臣及び財務大臣 設立:昭和28年8月
	(資本構成) 平成17年3月期 融資勘定 資本金4,619億円 全額政府出資
	(事業内容) 中小企業に対する融資業務、証券化支援業務、信用保険業務
	(業況) 平成17年3月期 融資勘定 当期利益金0円 総貸付金残高7兆5,000億円
	(その他) 本件は募集型証券化につきRM部署と証券化部署間の情報遮断なし
	リスクに対する手当て
	信用補完・流動性補完 信用補完:免責金額(2,105,000,000円(10.58%))の設定 流動性補完:流動性補完の措置はない
	トリガー指標の水準
	イベント発生の有無 早期終了事由、サービス解任事由、タックスイベントほかイベントの発生なし
レベル1 リスクに対する手当て 信用補完・流動性補完	ウォーターフォール 下記図1参照
	劣後部分現存額 免責金額 2,105,000,000円
	劣後部分毀損額 (合計) — (うち通常償還要因) — (うちデフォルト要因) —
	—
	—

図1:ウォーターフォール



(注)社債のクーポン支払に不足が生じる場合は、当該不足額について費用支払口座から支払う。

