

地域金融機関CLOに係る資産の状況
平成21年2月時点
(月次速報)

(単位:千円、社)

案件名	原資産(*1)						現状有姿交付債権(累計)B		累積デフォルト債権(A+B)	
			うち延滞債権		うちデフォルト債権(*2)A					
	金額	債務者数	金額	債務者数	金額	債務者数	金額	債務者数	金額	債務者数
平成18年3月CDO	817,400	303	110,688	11	0	0	230,007	12	230,007	12
平成18年9月CLO	6,254,894	326	108,000	3	174,642	6	345,669	10	520,311	16
平成19年3月CLO	3,655,481	264	56,500	3	56,481	2	52,000	4	108,481	6
平成19年6月CLO	9,133,600	345	97,500	2	294,500	7	363,500	7	658,000	14
平成19年9月CLO	7,446,750	232	0	0	60,000	1	197,000	3	257,000	4
平成19年12月CLO	7,861,350	238	22,950	1	112,000	3	80,000	2	192,000	5
平成20年3月CLO	8,523,050	216	63,000	2	93,500	2	117,000	2	210,500	4

*1: 原資産とは、各債務者と締結した金銭消費貸借契約に基づく報告月時点の債権残高を指す。

*2: 現状有姿交付できないデフォルト債権を含む。

地域金融機関CLOに係る資産の状況
平成21年2月時点
(月次速報)

(単位:千円、件)

案件名	原資産(*1)		うち延滞債権		うちデフォルト債権(*2)		累積ポートフォリオデフォルト(*3)		(参考) 参照債務(*4)
	金額	債務者数	金額	債務者数	金額	債務者数	金額	債務者数	金額
平成19年2月CLO (たんぽぽ2007)	10,893,762	1,109	250,198	16	97,556	8	1,260,213	63	13,172,184
平成19年9月CLO (こすもす2007)	3,706,749	294	66,134	3	39,743	2	253,737	13	4,599,185
平成20年3月CLO (たんぽぽ2008)	19,387,021	1,173	388,808	10	80,845	3	288,959	10	22,680,719

*1:原資産とは、個々の参照組織の金銭消費貸借契約に基づく報告月時点の債権残高を指す。

*2:クレジットイベントが確定していない債権を指す。

*3:クレジットイベントが確定した債権を指す。

*4:直近のプレミアム計算想定元本確定日における残高を指す。