

地域金融機関CLOに係る資産の状況
平成21年3月時点
(月次速報)

(単位:千円、社)

案件名	原資産(*1)		うち延滞債権		うちデフォルト債権(*2)A		現状有姿交付債権(累計)B		累積デフォルト債権(A+B)	
	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	104,686	11	0	0	104,686	11	230,007	12	334,693	23
平成18年9月CLO	5,695,948	326	171,003	7	218,335	7	345,669	10	564,004	17
平成19年3月CLO	3,384,981	264	92,000	5	76,981	4	52,000	4	128,981	8
平成19年6月CLO	8,517,200	345	209,500	6	294,500	7	363,500	7	658,000	14
平成19年9月CLO	6,966,300	232	135,000	4	105,000	2	197,000	3	302,000	5
平成19年12月CLO	7,384,950	238	126,950	3	112,000	3	80,000	2	192,000	5
平成20年3月CLO	8,014,400	215	129,500	3	178,500	4	117,000	2	295,500	6

*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3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)	8,661,263	1,097	263,891	16	5,539	1	1,357,769	71	10,823,142
平成19年9月CLO (こすもす2007)	3,464,481	291	77,809	4	0	0	293,480	15	3,856,745
平成20年3月CLO (たんぽぽ2008)	18,567,654	1,171	448,820	11	84,457	3	329,513	12	20,150,962

*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。