

地域金融機関CLOに係る資産の状況
平成23年5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9月CLO	1,340,496	273	147,250	13	251,646	10	364,672	12	616,318	22
平成19年3月CLO	1,222,231	250	173,750	14	90,481	5	61,000	6	151,481	11
平成19年6月CLO	3,111,057	296	254,300	20	354,507	10	491,000	15	845,507	25
平成19年9月CLO	2,669,700	209	90,000	3	0	0	636,535	16	636,535	16
平成19年12月CLO	3,185,400	218	168,000	7	69,350	3	301,200	9	370,550	12
平成20年3月CLO	3,475,200	189	154,000	5	24,000	2	608,155	13	632,155	15

*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23年5月時点
(月次速報)

(単位:千円、件)

案件名	取扱金融機関名	原資産(*1)						累積ポートフォリオデフォルト(*3)		免責金額(B)	B-A
				うち延滞債権		うちデフォルト債権(*2)					
		金額	債務者数	金額	債務者数	金額	債務者数	金額(A)	債務者数		
平成23年3月CLO (クローバー)	西京信用金庫	759,930	30	0	0	0	0	0	0	128,000	128,000
	富山信用金庫	464,675	28	46,055	1	0	0	0	0	74,000	74,000
	北伊勢上野信用金庫	563,660	33	0	0	0	0	0	0	65,000	65,000
	大阪信用金庫	508,075	36	0	0	0	0	0	0	55,000	55,000
	淡路信用金庫	586,225	13	0	0	0	0	0	0	165,000	165,000
	合計	2,882,565	140	46,055	1	0	0	0	0	487,000	—

*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。