

地域金融機関CLOに係る資産の状況
平成23年6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	858,206	272	136,450	13	251,556	10	364,672	12	616,228	22
平成19年3月CLO	985,231	250	178,250	14	101,981	7	61,000	6	162,981	13
平成19年6月CLO	2,613,357	296	268,050	23	354,507	10	491,000	15	845,507	25
平成19年9月CLO	2,204,750	207	90,000	3	0	0	636,535	16	636,535	16
平成19年12月CLO	2,758,750	217	213,500	9	69,350	3	301,200	9	370,550	12
平成20年3月CLO	3,051,050	187	170,000	6	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6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	736,916	30	0	0	0	0	0	0	128,000	128,000
	富山信用金庫	451,999	28	46,055	1	0	0	0	0	74,000	74,000
	北伊勢上野信用金庫	546,592	33	0	0	0	0	0	0	65,000	65,000
	大阪信用金庫	492,690	36	0	0	0	0	0	0	55,000	55,000
	淡路信用金庫	568,470	13	0	0	0	0	0	0	165,000	165,000
	合計	2,796,667	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。