

地域金融機関CLOに係る資産の状況
平成23年8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	856,090	272	134,500	12	250,790	10	364,672	12	615,462	22
平成19年3月CLO	977,079	249	172,250	13	95,329	6	66,500	7	161,829	13
平成19年6月CLO	2,602,964	295	251,300	20	352,464	10	491,000	15	843,464	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	2,683,250	214	184,000	8	29,350	2	341,200	10	370,550	12
平成20年3月CLO	3,020,519	186	158,500	5	32,969	3	608,155	13	641,124	16

*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8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	690,888	30	0	0	0	0	0	0	128,000	128,000
	富山信用金庫	426,647	28	46,055	1	0	0	0	0	74,000	74,000
	北伊勢上野信用金庫	512,456	33	0	0	0	0	0	0	65,000	65,000
	大阪信用金庫	461,920	36	0	0	0	0	0	0	55,000	55,000
	淡路信用金庫	537,170	13	67,370	1	0	0	0	0	165,000	165,000
	合計	2,629,081	140	113,425	2	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。