

地域金融機関CLOに係る資産の状況
平成24年2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19年3月CLO	499,079	246	171,250	13	95,329	6	66,500	7	161,829	13
平成19年6月CLO	1,599,008	291	201,800	19	434,308	18	491,000	15	925,308	33
平成19年9月CLO	1,349,380	205	104,500	6	25,530	1	636,535	16	662,065	17
平成19年12月CLO	1,757,516	210	79,000	5	73,916	4	386,771	11	460,687	15
平成20年3月CLO	2,190,250	184	178,000	6	24,000	2	617,124	14	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24年2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	552,804	30	0	0	0	0	0	0	128,000	128,000
	富山信用金庫	350,591	28	46,055	1	0	0	0	0	74,000	74,000
	北伊勢上野信用金庫	410,048	33	0	0	0	0	0	0	65,000	65,000
	大阪信用金庫	366,448	35	22,110	1	0	0	0	0	55,000	55,000
	淡路信用金庫	443,270	13	67,370	1	0	0	0	0	165,000	165,000
	合計	2,123,161	139	135,535	3	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。