

地域金融機関CLOに係る資産の状況
平成25年12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 | 71,212 | 29 | 28,440 | 2 | 0 | 0 | 0 | 0 | 128,000 | 128,000 |
| | 富山信用金庫 | 69,806 | 25 | 51,058 | 2 | 0 | 0 | 0 | 0 | 74,000 | 74,000 |
| | 北伊勢上野信用金庫 | 62,519 | 31 | 31,911 | 2 | 0 | 0 | 0 | 0 | 65,000 | 65,000 |
| | 大阪信用金庫 | 43,396 | 28 | 22,116 | 3 | 0 | 0 | 27,639 | 2 | 55,000 | 27,361 |
| | 淡路信用金庫 | 96,026 | 11 | 67,370 | 1 | 0 | 0 | 0 | 0 | 165,000 | 165,000 |
| | 合計 | 342,959 | 124 | 200,895 | 10 | 0 | 0 | 27,639 | 2 | 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。