

## 地域金融機関CLO シンセティック型（株式会社こすもす2007）発行要項

以下は、「地域金融機関CLO シンセティック型（株式会社こすもす2007）」に係るCLOの内容です。

発行金額 (格付：R&I/Moody`s)	A号無担保社債 6,500百万円 (AAA / Aaa) B号無担保社債 10百万円 (AAA / A2)
利率 (年率)	A号無担保社債 TIBOR + 0.32% B号無担保社債 TIBOR + 0.57%
発行予定日	平成19年9月27日
予定償還期日 (最終償還期日)	平成22年11月1日 (平成23年1月4日)
利払日	3ヵ月毎(毎年3月、6月、9月、12月。但し、平成22年9月は除く。) (当該期日が営業日でない場合は、その翌営業日。)
償還方法	初回を平成19年12月20日とし、毎年3月、6月、9月及び12月に順次償還(平成22年9月を除く) (当該期日が営業日でない場合は、その翌営業日。) パススルー (A号無担保社債、B号無担保社債の割合に応じたプロラタ償還)
参照プールの概要	地域金融機関CLO シンセティック型(株式会社こすもす2007)参加金融機関が募集した中小企業向け貸付債権(無担保・第三者保証なし)310件(309社)/当初総額:74.22億円  デフォルト確率(加重平均) CRD(モデル)0.59% / RDB(SME)0.75% / リスクカルク(v3.1)0.52%
裏付け資産	クレジットデフォルトスワップ契約、預金
参加金融機関 (オリジネーター/ バイヤー)	岩手銀行、大分銀行、北日本銀行、豊和銀行、宮崎太陽銀行、福島信用金庫、千葉信用金庫、尾西信用金庫、滋賀中央信用金庫、大阪信用金庫、淡路信用金庫、大分みらい信用金庫 「平成19年度大分県CLO」参加金融機関 (5銀行、7信用金庫。金融機関コード順)
セラー	株式会社こすもす2007
独立認定人	新日本監査法人
発行代わり金預入銀行	参加金融機関の普通預金(無利息)口座(決済用預金)
社債管理者	住友信託銀行株式会社
私募の取扱者	みずほ証券株式会社