

地域金融機関CLO シンセティック型（合同会社クローバー2016）発行要項

以下は、「地域金融機関CLO シンセティック型（合同会社クローバー2016）」に係るCLOの内容です。

発行金額 (格付: Moody's)	<p>A号無担保社債 6,000.0百万円 (Aaa(sf))</p> <p>B号無担保社債 4,339.0百万円 (Baa1(sf))</p> <p>C号無担保保証付社債(※) 1,500.0百万円 (A1(sf))</p> <p>(※) C号社債の元本及び利息支払いに対し、日本公庫による全額保証が付される</p>
利率(年率)	<p>A号無担保社債 3ヵ月 TIBOR+0.41%</p> <p>B号無担保社債 非公表</p> <p>C号無担保保証付社債 3ヵ月 TIBOR+0.32%</p>
発行予定日	平成28年3月28日
予定償還期日	平成31年4月30日
利払日	3ヵ月毎(毎年3月、6月、9月、12月。) (当該期日が営業日でない場合はその翌営業日)
償還方法	<p>初回を平成28年6月20日とし、毎年3月、6月、9月及び12月に順次償還。</p> <p>(当該期日が営業日でない場合はその翌営業日)</p> <p>A号、B号及びC号: パススルー償還</p> <p>(原則としてC号社債はA号及びB号社債元本が全額償還された場合に償還される)</p>
参照プールの概要	<p>地域金融機関CLO シンセティック型(合同会社クローバー2016) 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) 525件(524社) / 当初総額: 12,167百万円</p> <p>※デフォルト確率(加重平均)</p> <p>CRD(モデル3) 0.30% / RDB(SME) 0.69%</p> <p>/ リスクカルク(v3.1) 0.37% / CRITS 0.79%</p>
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) 個別CDS※バイヤー	<p>株式会社清水銀行、株式会社東日本銀行、西武信用金庫、諏訪信用金庫、富山信用金庫、金沢信用金庫、大阪信用金庫、米子信用金庫、長野県信用組合</p> <p>(2銀行、6信用金庫、1信用組合、金融機関コード順)</p> <p>※参加金融機関、株式会社日本政策金融公庫及び計算代理人との間で締結するCDS契約</p>
個別CDSセラー/ 第2CDS※バイヤー	<p>株式会社日本政策金融公庫</p> <p>※合同会社クローバー2016、株式会社日本政策金融公庫及び計算代理人との間で締結するCDS契約</p>
第2CDSセラー	合同会社クローバー2016
独立認定人	有限会社東京共同会計事務所
発行代わり金預入銀行	株式会社三井住友銀行
社債管理者	株式会社三井住友銀行
私募の取扱者	三菱UFJモルガン・スタンレー証券株式会社