

地域金融機関CLOシンセティック型（合同会社クローバー2017）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2017）」に係るCLOの内容です。

発行金額 (格付：R & I)	A号無担保社債 13,400.0百万円 (AAA) B号無担保社債 9,203.0百万円 (BBB-) C号無担保社債(※) 2,200.0百万円 (AA+) (※) 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
利率(年率)	A号無担保社債 3ヵ月TIBOR+0.31% B号無担保社債 非公表 C号無担保社債 3ヵ月TIBOR+0.20%
発行日	平成29年3月3日
予定償還期日	平成33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	<ul style="list-style-type: none"> ・初回を平成29年6月20日とし、毎年3月、6月、9月及び12月に順次償還(当該期日が営業日でない場合はその翌営業日) ・A号及びB号社債はパススルー償還 ・C号社債は満期一括償還(ただし、A号及びB号社債の全額償還後に償還が開始され、順次償還される場合がある)
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2017)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) 1,019件(1,009社) / 当初総額: 25,748百万円</p> <p><デフォルト確率(加重平均)> RDB(SME) 0.82% / リスクカルク(v3.1) 0.43% / CRITS 0.84%</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>株式会社七十七銀行、株式会社清水銀行、株式会社但馬銀行、株式会社東日本銀行、株式会社みなと銀行、株式会社福岡中央銀行、飯能信用金庫、朝日信用金庫、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、大阪シティ信用金庫、姫路信用金庫、西中国信用金庫、愛媛信用金庫、長野県信用組合 (6銀行、11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	株式会社日本政策金融公庫 ※合同会社クローバー2017、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
第2CDSセラー	合同会社クローバー2017
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
財務代理人	株式会社三井住友銀行
主幹事証券会社	大和証券株式会社