

地域金融機関CLOシンセティック型（合同会社クローバー2018）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2018）」に係るCLOの内容です。

発行金額 (格付：R & I)	A号無担保社債 16,300百万円 (AAA) B号無担保社債 6,867百万円 (BBB+) C号無担保社債 (※) 2,900百万円 (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+0.22% B号無担保社債 非公表 C号無担保社債 3ヵ月 TIBOR+0.11%
発行日	平成30年3月16日
予定償還期日	平成34年5月31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	・初回を平成30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	地域金融機関 CLO シンセティック型 (合同会社クローバー2018) 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) 1,106件 (1,095社) / 当初総額: 27,030百万円 ＜デフォルト確率 (加重平均)＞ CRD (モデル3) 0.37% / RDB (SME) 0.78% / リスクカルク (v3.1) 0.46% / CRITS 0.86%
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	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、株式会社鳥取銀行、株式会社北日本銀行、株式会社東日本銀行、株式会社みなと銀行、帯広信用金庫、朝日信用金庫、西武信用金庫、多摩信用金庫、諏訪信用金庫、富山信用金庫、金沢信用金庫、福井信用金庫、大阪信用金庫、大阪シティ信用金庫、姫路信用金庫、しまなみ信用金庫、徳島信用金庫、愛媛信用金庫、長野県信用組合 (7銀行、14信用金庫、1信用組合。金融機関コード順) ※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
個別 CDS セラー / 第2 CDS※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2018、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2 CDS セラー	合同会社クローバー2018
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	株式会社三井住友信託銀行
財務代理人	株式会社三井住友信託銀行
主幹事証券会社	大和証券株式会社