



Contact:

東京
 齋藤 奈都子 / シニア・アソシエイト
 増田 厚 / アナリスト
 ストラクチャード・ファイナンス
 ムーディーズ・ジャパン株式会社
 お問い合わせ電話番号：03-5408-4100
 報道関係者専用番号：03-5408-4110

東京
 関 雄介
 シニア・バイスプレジデント
 ストラクチャード・ファイナンス
 ムーディーズ・ジャパン株式会社
 お問い合わせ電話番号：03-5408-4100
 報道関係者専用番号：03-5408-4110

ムーディーズ、地域金融機関平成 19 年 12 月 CL0 に格付けを付与

総額 86.4 億円の信託受益権を対象として

2007 年（平成 19 年）12 月 11 日、東京、ムーディーズ・インベスターズ・サービスは、中小企業金融公庫が実施する買取型及び自己型合同案件「地域金融機関平成 19 年 12 月 CL0」に格付けを付与した。

ムーディーズによる格付けは、法定最終償還日までに投資家が被りうる期待損失に関して付与されたものである。本取引は、期日通りの配当支払い並びに法定最終償還日までの元本の全額償還がなされるように組成されている。

格付けの概要は以下の通り。

格付け対象：

クラス	発行金額	配当率	格付け
優先受益権	8,300,000,000 円	固定	Aaa
メザニン受益権	340,000,000 円	固定	A2

信託設定日：2007 年 12 月 26 日

予定最終償還日：2013 年 1 月 15 日

法定最終償還日：2014 年 1 月 15 日

裏付債権：中小企業向け貸付債権

債権元本総額：9,920,000,000 円

参加金融機関（オリジネーター／サービサー）：株式会社愛媛銀行、中小企業金融公庫

委託者：中小企業金融公庫

受託者：みずほ信託銀行株式会社

アレンジャー：日興シティグループ証券株式会社

本取引は、(a) 中小企業金融公庫が「買取型」スキームの下で株式会社愛媛銀行から買取った中小企業向け貸付債権、及び(b) 中小企業金融公庫自身が「自己型」スキームの下で実行した中小企業向け貸付債権を裏付けとする CLO である。なお、(a)及び(b)の貸付債権は、当初より証券化することを目的として実行されたものである。

本取引に対する格付けは、以下の理由に基づくものである。

- (1) 裏付債権プールの信用力及び分散度
- (2) 優先劣後構造により提供される信用補完水準
- (3) 参加金融機関及び中小企業金融公庫による募集審査
- (4) 法的側面からみたストラクチャーの強み

ムーディーズ・インベスターズ・サービスは格付けの意見およびリサーチを出版する会社である。証券の募集・販売、あるいは募集を行う会社の代理業務を行うことはない。また、このプレス・リリースは証券の購入、保有、または売却を勧誘・推奨するものではない。

以上