

「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)」発行後情報開示サマリー

(令和元年12月6日時点)

1. 発行の概要

項目	A号無担保社債	C号無担保保証付社債
発行証券総額	¥13,400,000,000	¥2,200,000,000
利率(注1)	Tibor+0.31%	Tibor+0.20%
予定償還日 または 予定償還スケジュール	【当初どおり変更なし】 ・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)	【当初どおり変更なし】 ・A号及びB号社債元本が全額償還後に順次償還(当該期日が営業日でない場合はその翌営業日)
格付(維持、変更等)情報	R & I 当初: AAA 現在: AAA	R & I 当初: AA+ 現在: AA+

(注1)3か月Tibor

2. ストラクチャー、関係者概要

項目	開示内容
主な関係者の情報	
参加金融機関 (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(合計18金融機関、金融機関コード順)
財務代理人	株式会社三井住友銀行
独立認定人	有限会社東京共同会計事務所
リスクに対する手当て	
信用補完・流動性補完	信用補完: 優先劣後構造 C号無担保保証付社債については日本公庫による保証 参加金融機関毎に設定する免責金額(約2.3%~約17.0%)の設定 流動性補完: プレミアムの3か月前取分、C号社債利息の当初2回分留保
劣後部分設定額	A号社債に対する劣後部分 B号社債(合計) ¥9,203,000,000(注1) C号社債(合計) ¥2,200,000,000(注1)(注2) 免責金額(合計) ¥945,000,000(注3)
うち劣後部分毀損額	B号社債(合計) ¥0(注4) C号社債(合計) ¥22,774,000(注2)(注4) 免責金額(合計) ¥211,694,000(注5)

(注1)当初社債発行額

(注2)C号社債の元本及び利息支払に対し日本公庫による全額保証が付される

(注3)当初免責金額

(注4)劣後部分を超過した累積ポートフォリオデフォルト金額の合計額

(注5)各CDS契約の累積ポートフォリオデフォルト金額の合計額

(但し、各バイヤー設定の免責金額を超過する累積ポートフォリオデフォルト金額は含まれない。)

3. 裏付資産の属性、性質

項目	債券発行時点(平成29年3月)	令和元年12月6日時点
参照債務残高	¥25,748,000,000	¥8,844,714,000(注3)
参照債務残高率	100.00%	34.35%
クレジットイベント発生率(注1)	0.00%	0.49%
累積クレジットイベント発生率(注2)	0.00%	0.91%
参照債務件数	1019件	965件
一参照債務あたり平均貸出残高	¥25,267,909	¥9,165,506

参照債務残高及び参照債務件数については、クレジットイベントが確定したものの、繰上償還があったものを同債務及び同件数から除く

(注1)クレジットイベント発生率(%): 期中確定デフォルト金額/期初参照債務残高

(注2)累積クレジットイベント発生率(%): 累積ポートフォリオデフォルト金額/当初参照債務残高

(注3)直近開示の月次パフォーマンスの原資産残高とは参照する時点が異なるため一致しない。原資産残高は、金銭消費貸借契約に基づく基準日時点の債権残高を指し、参照債務残高は、CDS契約に基づくプレミアム計算想定元本確定日(以下、「元本確定日」という。))において参照する時点(第1プレミアム計算小期間の末日)の債権残高を指している。ただし、参照時点から元本確定日までの間に参照債務の変動(延滞及び期限前返済の判明並びにクレジットイベントの確定)が生じた場合、参照時点に属する月次パフォーマンスの原資産残高と乖離が生じる。

「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)」発行後情報開示サマリー

(令和元年12月6日時点)

4. 個別オリジネーター毎の状況

金融機関名	参照債務残高		デフォルト金額(注1)		(ご参考)
	当初 (29年3月)	現在 (1年12月6日)	1.9.6~1.12.6	累積	免責金額
七十七銀行	¥330,000,000	¥99,023,000	¥0	¥78,774,000	¥56,000,000
清水銀行	¥2,140,000,000	¥748,356,000	¥0	¥0	¥80,000,000
但馬銀行	¥1,049,000,000	¥380,741,000	¥0	¥0	¥29,000,000
東日本銀行	¥1,464,000,000	¥534,636,000	¥0	¥0	¥43,000,000
みなと銀行	¥4,304,000,000	¥1,381,249,000	¥0	¥33,344,000	¥167,000,000
福岡中央銀行	¥1,352,000,000	¥465,346,000	¥0	¥14,384,000	¥60,000,000
飯能信用金庫	¥479,000,000	¥160,152,000	¥0	¥0	¥22,000,000
朝日信用金庫	¥855,000,000	¥303,479,000	¥0	¥0	¥21,000,000
西武信用金庫	¥4,862,000,000	¥1,743,864,000	¥27,098,000	¥53,780,000	¥110,000,000
諏訪信用金庫	¥414,000,000	¥146,904,000	¥0	¥0	¥22,000,000
富山信用金庫	¥931,000,000	¥310,715,000	¥0	¥0	¥30,000,000
金沢信用金庫	¥1,300,000,000	¥412,391,000	¥23,975,000	¥23,975,000	¥73,000,000
大阪信用金庫	¥975,000,000	¥329,402,000	¥0	¥8,336,000	¥37,000,000
大阪シティ信用金庫	¥786,000,000	¥252,360,000	¥0	¥21,875,000	¥29,000,000
姫路信用金庫	¥830,000,000	¥304,353,000	¥0	¥0	¥24,000,000
西中国信用金庫	¥987,000,000	¥328,824,000	¥0	¥0	¥43,000,000
愛媛信用金庫	¥438,000,000	¥143,577,000	¥0	¥0	¥36,000,000
長野県信用組合	¥2,252,000,000	¥799,342,000	¥0	¥0	¥63,000,000
合計	¥25,748,000,000	¥8,844,714,000	¥51,073,000	¥234,468,000	¥945,000,000

(注1) 掲示している期間内に確定しているデフォルト金額

全体

プレミアム計算期間	参照債務残高 (開始日)	参照債務 減少額	参照債務残高 (末日)	デフォルト金額	累積ポートフォリオ デフォルト金額	免責金額	免責超過金額 合計※1
2017/3/3 ~ 2017/6/20	25,748,000,000	575,149,000	25,172,851,000	0	0	945,000,000	0
2017/6/21 ~ 2017/9/20	25,172,851,000	1,660,447,000	23,512,404,000	0	0	945,000,000	0
2017/9/21 ~ 2017/12/20	23,512,404,000	1,596,076,000	21,916,328,000	0	0	945,000,000	0
2017/12/21 ~ 2018/3/20	21,916,328,000	1,617,966,000	20,298,362,000	0	0	945,000,000	0
2018/3/21 ~ 2018/6/20	20,298,362,000	1,701,222,000	18,597,140,000	8,336,000	8,336,000	945,000,000	0
2018/6/21 ~ 2018/9/20	18,597,140,000	1,658,452,000	16,938,688,000	0	8,336,000	945,000,000	0
2018/9/21 ~ 2018/12/20	16,938,688,000	1,652,633,000	15,286,055,000	36,259,000	44,595,000	945,000,000	0
2018/12/21 ~ 2019/3/20	15,286,055,000	1,628,479,000	13,657,576,000	49,594,000	94,189,000	945,000,000	0
2019/3/21 ~ 2019/6/20	13,657,576,000	1,680,841,000	11,976,735,000	26,682,000	120,871,000	945,000,000	0
2019/6/21 ~ 2019/9/20	11,976,735,000	1,565,854,000	10,410,881,000	62,524,000	183,395,000	945,000,000	22,774,000
2019/9/21 ~ 2019/12/20	10,410,881,000	1,566,167,000	8,844,714,000	51,073,000	234,468,000	945,000,000	22,774,000
2019/12/21 ~ 2020/3/23	8,844,714,000			0	234,468,000	945,000,000	0
2020/3/24 ~ 2020/6/22				0	234,468,000	945,000,000	0
2020/6/23 ~ 2020/9/23				0	234,468,000	945,000,000	0
2020/9/24 ~ 2020/12/21				0	234,468,000	945,000,000	0
2020/12/22 ~ 2021/4/30				0	234,468,000	945,000,000	0

※1: 免責超過金額合計=各バイヤーの免責超過金額の合計

七十七銀行

プレミアム計算期間	参照債務残高 (開始日)	参照債務 減少額	参照債務残高 (末日)	デフォルト金額	累積ポートフォリオ デフォルト金額	免責金額	免責超過金額※2
2017/3/3 ~ 2017/6/20	330,000,000	6,871,000	323,129,000	0	0	56,000,000	0
2017/6/21 ~ 2017/9/20	323,129,000	20,613,000	302,516,000	0	0	56,000,000	0
2017/9/21 ~ 2017/12/20	302,516,000	17,490,000	285,026,000	0	0	56,000,000	0
2017/12/21 ~ 2018/3/20	285,026,000	17,490,000	267,536,000	0	0	56,000,000	0
2018/3/21 ~ 2018/6/20	267,536,000	17,490,000	250,046,000	0	0	56,000,000	0
2018/6/21 ~ 2018/9/20	250,046,000	17,490,000	232,556,000	0	0	56,000,000	0
2018/9/21 ~ 2018/12/20	232,556,000	15,408,000	217,148,000	0	0	56,000,000	0
2018/12/21 ~ 2019/3/20	217,148,000	11,244,000	205,904,000	0	0	56,000,000	0
2019/3/21 ~ 2019/6/20	205,904,000	25,619,000	180,285,000	16,250,000	16,250,000	56,000,000	0
2019/6/21 ~ 2019/9/20	180,285,000	71,893,000	108,392,000	62,524,000	78,774,000	56,000,000	22,774,000
2019/9/21 ~ 2019/12/20	108,392,000	9,369,000	99,023,000	0	78,774,000	56,000,000	22,774,000
2019/12/21 ~ 2020/3/23	99,023,000					56,000,000	
2020/3/24 ~ 2020/6/22						56,000,000	
2020/6/23 ~ 2020/9/23						56,000,000	
2020/9/24 ~ 2020/12/21						56,000,000	
2020/12/22 ~ 2021/4/30						56,000,000	

「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)」発行後情報開示サマリー

(令和元年12月6日時点)

清水銀行

プレミアム計算期間	参照債務残高 (開始日)	参照債務 減少額	参照債務残高 (末日)	デフォルト金額	累積ホートフォ デフォルト金額	免責金額	免責超過金額※2
2017/3/3 ~ 2017/6/20	2,140,000,000	44,548,000	2,095,452,000	0	0	80,000,000	0
2017/6/21 ~ 2017/9/20	2,095,452,000	133,644,000	1,961,808,000	0	0	80,000,000	0
2017/9/21 ~ 2017/12/20	1,961,808,000	133,644,000	1,828,164,000	0	0	80,000,000	0
2017/12/21 ~ 2018/3/20	1,828,164,000	133,644,000	1,694,520,000	0	0	80,000,000	0
2018/3/21 ~ 2018/6/20	1,694,520,000	155,532,000	1,538,988,000	0	0	80,000,000	0
2018/6/21 ~ 2018/9/20	1,538,988,000	131,772,000	1,407,216,000	0	0	80,000,000	0
2018/9/21 ~ 2018/12/20	1,407,216,000	131,772,000	1,275,444,000	0	0	80,000,000	0
2018/12/21 ~ 2019/3/20	1,275,444,000	131,772,000	1,143,672,000	0	0	80,000,000	0
2019/3/21 ~ 2019/6/20	1,143,672,000	131,772,000	1,011,900,000	0	0	80,000,000	0
2019/6/21 ~ 2019/9/20	1,011,900,000	131,772,000	880,128,000	0	0	80,000,000	0
2019/9/21 ~ 2019/12/20	880,128,000	131,772,000	748,356,000	0	0	80,000,000	0
2019/12/21 ~ 2020/3/23	748,356,000					80,000,000	0
2020/3/24 ~ 2020/6/22						80,000,000	0
2020/6/23 ~ 2020/9/23						80,000,000	0
2020/9/24 ~ 2020/12/21						80,000,000	0
2020/12/22 ~ 2021/4/30						80,000,000	0

但馬銀行

プレミアム計算期間	参照債務残高 (開始日)	参照債務 減少額	参照債務残高 (末日)	デフォルト金額	累積ホートフォ デフォルト金額	免責金額	免責超過金額※2
2017/3/3 ~ 2017/6/20	1,049,000,000	21,839,000	1,027,161,000	0	0	29,000,000	0
2017/6/21 ~ 2017/9/20	1,027,161,000	65,517,000	961,644,000	0	0	29,000,000	0
2017/9/21 ~ 2017/12/20	961,644,000	65,517,000	896,127,000	0	0	29,000,000	0
2017/12/21 ~ 2018/3/20	896,127,000	65,517,000	830,610,000	0	0	29,000,000	0
2018/3/21 ~ 2018/6/20	830,610,000	65,517,000	765,093,000	0	0	29,000,000	0
2018/6/21 ~ 2018/9/20	765,093,000	65,517,000	699,576,000	0	0	29,000,000	0
2018/9/21 ~ 2018/12/20	699,576,000	64,267,000	635,309,000	0	0	29,000,000	0
2018/12/21 ~ 2019/3/20	635,309,000	63,642,000	571,667,000	0	0	29,000,000	0
2019/3/21 ~ 2019/6/20	571,667,000	63,642,000	508,025,000	0	0	29,000,000	0
2019/6/21 ~ 2019/9/20	508,025,000	63,642,000	444,383,000	0	0	29,000,000	0
2019/9/21 ~ 2019/12/20	444,383,000	63,642,000	380,741,000	0	0	29,000,000	0
2019/12/21 ~ 2020/3/23	380,741,000					29,000,000	0
2020/3/24 ~ 2020/6/22						29,000,000	0
2020/6/23 ~ 2020/9/23						29,000,000	0
2020/9/24 ~ 2020/12/21						29,000,000	0
2020/12/22 ~ 2021/4/30						29,000,000	0

東日本銀行

プレミアム計算期間	参照債務残高 (開始日)	参照債務 減少額	参照債務残高 (末日)	デフォルト金額	累積ホートフォ デフォルト金額	免責金額	免責超過金額※2
2017/3/3 ~ 2017/6/20	1,464,000,000	30,483,000	1,433,517,000	0	0	43,000,000	0
2017/6/21 ~ 2017/9/20	1,433,517,000	91,449,000	1,342,068,000	0	0	43,000,000	0
2017/9/21 ~ 2017/12/20	1,342,068,000	91,449,000	1,250,619,000	0	0	43,000,000	0
2017/12/21 ~ 2018/3/20	1,250,619,000	88,326,000	1,162,293,000	0	0	43,000,000	0
2018/3/21 ~ 2018/6/20	1,162,293,000	88,326,000	1,073,967,000	0	0	43,000,000	0
2018/6/21 ~ 2018/9/20	1,073,967,000	88,326,000	985,641,000	0	0	43,000,000	0
2018/9/21 ~ 2018/12/20	985,641,000	106,451,000	879,190,000	0	0	43,000,000	0
2018/12/21 ~ 2019/3/20	879,190,000	86,451,000	792,739,000	0	0	43,000,000	0
2019/3/21 ~ 2019/6/20	792,739,000	86,451,000	706,288,000	0	0	43,000,000	0
2019/6/21 ~ 2019/9/20	706,288,000	85,619,000	620,669,000	0	0	43,000,000	0
2019/9/21 ~ 2019/12/20	620,669,000	86,033,000	534,636,000	0	0	43,000,000	0
2019/12/21 ~ 2020/3/23	534,636,000					43,000,000	0
2020/3/24 ~ 2020/6/22						43,000,000	0
2020/6/23 ~ 2020/9/23						43,000,000	0
2020/9/24 ~ 2020/12/21						43,000,000	0
2020/12/22 ~ 2021/4/30						43,000,000	0

みなと銀行

プレミアム計算期間	参照債務残高 (開始日)	参照債務 減少額	参照債務残高 (末日)	デフォルト金額	累積ホートフォ デフォルト金額	免責金額	免責超過金額※2
2017/3/3 ~ 2017/6/20	4,304,000,000	89,609,000	4,214,391,000	0	0	167,000,000	0
2017/6/21 ~ 2017/9/20	4,214,391,000	296,327,000	3,918,064,000	0	0	167,000,000	0
2017/9/21 ~ 2017/12/20	3,918,064,000	266,952,000	3,651,112,000	0	0	167,000,000	0
2017/12/21 ~ 2018/3/20	3,651,112,000	266,952,000	3,384,160,000	0	0	167,000,000	0
2018/3/21 ~ 2018/6/20	3,384,160,000	279,036,000	3,105,124,000	0	0	167,000,000	0
2018/6/21 ~ 2018/9/20	3,105,124,000	314,798,000	2,790,326,000	0	0	167,000,000	0
2018/9/21 ~ 2018/12/20	2,790,326,000	293,463,000	2,496,863,000	0	0	167,000,000	0
2018/12/21 ~ 2019/3/20	2,496,863,000	327,027,000	2,169,836,000	33,344,000	33,344,000	167,000,000	0
2019/3/21 ~ 2019/6/20	2,169,836,000	340,602,000	1,829,234,000	0	33,344,000	167,000,000	0
2019/6/21 ~ 2019/9/20	1,829,234,000	215,336,000	1,613,898,000	0	33,344,000	167,000,000	0
2019/9/21 ~ 2019/12/20	1,613,898,000	232,649,000	1,381,249,000	0	33,344,000	167,000,000	0
2019/12/21 ~ 2020/3/23	1,381,249,000					167,000,000	0
2020/3/24 ~ 2020/6/22						167,000,000	0
2020/6/23 ~ 2020/9/23						167,000,000	0
2020/9/24 ~ 2020/12/21						167,000,000	0
2020/12/22 ~ 2021/4/30						167,000,000	0

福岡中央銀行

プレミアム計算期間	参照債務残高 (開始日)	参照債務 減少額	参照債務残高 (末日)	デフォルト金額	累積ホートフォ デフォルト金額	免責金額	免責超過金額※2
2017/3/3 ~ 2017/6/20	1,352,000,000	57,514,000	1,294,486,000	0	0	60,000,000	0
2017/6/21 ~ 2017/9/20	1,294,486,000	82,542,000	1,211,944,000	0	0	60,000,000	0
2017/9/21 ~ 2017/12/20	1,211,944,000	82,542,000	1,129,402,000	0	0	60,000,000	0
2017/12/21 ~ 2018/3/20	1,129,402,000	97,132,000	1,032,270,000	0	0	60,000,000	0
2018/3/21 ~ 2018/6/20	1,032,270,000	79,419,000	952,851,000	0	0	60,000,000	0
2018/6/21 ~ 2018/9/20	952,851,000	78,379,000	874,472,000	0	0	60,000,000	0
2018/9/21 ~ 2018/12/20	874,472,000	91,931,000	782,541,000	14,384,000	14,384,000	60,000,000	0
2018/12/21 ~ 2019/3/20	782,541,000	77,547,000	704,994,000	0	14,384,000	60,000,000	0
2019/3/21 ~ 2019/6/20	704,994,000	77,547,000	627,447,000	0	14,384,000	60,000,000	0
2019/6/21 ~ 2019/9/20	627,447,000	81,099,000	546,348,000	0	14,384,000	60,000,000	0
2019/9/21 ~ 2019/12/20	546,348,000	81,002,000	465,346,000	0	14,384,000	60,000,000	0
2019/12/21 ~ 2020/3/23	465,346,000					60,000,000	0
2020/3/24 ~ 2020/6/22						60,000,000	0
2020/6/23 ~ 2020/9/23						60,000,000	0
2020/9/24 ~ 2020/12/21						60,000,000	0
2020/12/22 ~ 2021/4/30						60,000,000	0

「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)」発行後情報開示サマリー

(令和元年12月6日時点)

飯能信用金庫

プレミアム計算期間	参照債務残高 (開始日)	参照債務 減少額	参照債務残高 (末日)	デフォルト金額	累積ホートフォ デフォルト金額	免責金額	免責超過金額※2
2017/3/3 ~ 2017/6/20	479,000,000	9,989,000	469,011,000	0	0	22,000,000	0
2017/6/21 ~ 2017/9/20	469,031,000	29,907,000	439,124,000	0	0	22,000,000	0
2017/9/21 ~ 2017/12/20	439,124,000	29,491,000	409,633,000	0	0	22,000,000	0
2017/12/21 ~ 2018/3/20	409,633,000	29,491,000	380,142,000	0	0	22,000,000	0
2018/3/21 ~ 2018/6/20	380,142,000	29,283,000	350,859,000	0	0	22,000,000	0
2018/6/21 ~ 2018/9/20	350,859,000	36,163,000	314,696,000	0	0	22,000,000	0
2018/9/21 ~ 2018/12/20	314,696,000	28,867,000	285,829,000	0	0	22,000,000	0
2018/12/21 ~ 2019/3/20	285,829,000	28,659,000	257,170,000	0	0	22,000,000	0
2019/3/21 ~ 2019/6/20	257,170,000	43,242,000	213,928,000	0	0	22,000,000	0
2019/6/21 ~ 2019/9/20	213,928,000	26,784,000	187,144,000	0	0	22,000,000	0
2019/9/21 ~ 2019/12/20	187,144,000	26,992,000	160,152,000	0	0	22,000,000	0
2019/12/21 ~ 2020/3/23	160,152,000					22,000,000	0
2020/3/24 ~ 2020/6/22						22,000,000	0
2020/6/23 ~ 2020/9/23						22,000,000	0
2020/9/24 ~ 2020/12/21						22,000,000	0
2020/12/22 ~ 2021/4/30						22,000,000	0

朝日信用金庫

プレミアム計算期間	参照債務残高 (開始日)	参照債務 減少額	参照債務残高 (末日)	デフォルト金額	累積ホートフォ デフォルト金額	免責金額	免責超過金額※2
2017/3/3 ~ 2017/6/20	855,000,000	17,791,000	837,209,000	0	0	21,000,000	0
2017/6/21 ~ 2017/9/20	837,209,000	53,373,000	783,836,000	0	0	21,000,000	0
2017/9/21 ~ 2017/12/20	783,836,000	53,373,000	730,463,000	0	0	21,000,000	0
2017/12/21 ~ 2018/3/20	730,463,000	53,373,000	677,090,000	0	0	21,000,000	0
2018/3/21 ~ 2018/6/20	677,090,000	53,373,000	623,717,000	0	0	21,000,000	0
2018/6/21 ~ 2018/9/20	623,717,000	53,373,000	570,344,000	0	0	21,000,000	0
2018/9/21 ~ 2018/12/20	570,344,000	53,373,000	516,971,000	0	0	21,000,000	0
2018/12/21 ~ 2019/3/20	516,971,000	53,373,000	463,598,000	0	0	21,000,000	0
2019/3/21 ~ 2019/6/20	463,598,000	53,373,000	410,225,000	0	0	21,000,000	0
2019/6/21 ~ 2019/9/20	410,225,000	53,373,000	356,852,000	0	0	21,000,000	0
2019/9/21 ~ 2019/12/20	356,852,000	53,373,000	303,479,000	0	0	21,000,000	0
2019/12/21 ~ 2020/3/23	303,479,000					21,000,000	0
2020/3/24 ~ 2020/6/22						21,000,000	0
2020/6/23 ~ 2020/9/23						21,000,000	0
2020/9/24 ~ 2020/12/21						21,000,000	0
2020/12/22 ~ 2021/4/30						21,000,000	0

西武信用金庫

プレミアム計算期間	参照債務残高 (開始日)	参照債務 減少額	参照債務残高 (末日)	デフォルト金額	累積ホートフォ デフォルト金額	免責金額	免責超過金額※2
2017/3/3 ~ 2017/6/20	4,862,000,000	101,221,000	4,760,779,000	0	0	110,000,000	0
2017/6/21 ~ 2017/9/20	4,760,779,000	303,663,000	4,457,116,000	0	0	110,000,000	0
2017/9/21 ~ 2017/12/20	4,457,116,000	301,581,000	4,155,535,000	0	0	110,000,000	0
2017/12/21 ~ 2018/3/20	4,155,535,000	300,540,000	3,854,995,000	0	0	110,000,000	0
2018/3/21 ~ 2018/6/20	3,854,995,000	299,499,000	3,555,496,000	0	0	110,000,000	0
2018/6/21 ~ 2018/9/20	3,555,496,000	297,417,000	3,258,079,000	0	0	110,000,000	0
2018/9/21 ~ 2018/12/20	3,258,079,000	297,417,000	2,960,662,000	0	0	110,000,000	0
2018/12/21 ~ 2019/3/20	2,960,662,000	313,667,000	2,646,995,000	16,250,000	16,250,000	110,000,000	0
2019/3/21 ~ 2019/6/20	2,646,995,000	299,937,000	2,347,058,000	10,432,000	26,682,000	110,000,000	0
2019/6/21 ~ 2019/9/20	2,347,058,000	288,048,000	2,059,010,000	0	26,682,000	110,000,000	0
2019/9/21 ~ 2019/12/20	2,059,010,000	315,146,000	1,743,864,000	27,098,000	53,780,000	110,000,000	0
2019/12/21 ~ 2020/3/23	1,743,864,000					110,000,000	0
2020/3/24 ~ 2020/6/22						110,000,000	0
2020/6/23 ~ 2020/9/23						110,000,000	0
2020/9/24 ~ 2020/12/21						110,000,000	0
2020/12/22 ~ 2021/4/30						110,000,000	0

諏訪信用金庫

プレミアム計算期間	参照債務残高 (開始日)	参照債務 減少額	参照債務残高 (末日)	デフォルト金額	累積ホートフォ デフォルト金額	免責金額	免責超過金額※2
2017/3/3 ~ 2017/6/20	414,000,000	8,616,000	405,384,000	0	0	22,000,000	0
2017/6/21 ~ 2017/9/20	405,384,000	25,848,000	379,536,000	0	0	22,000,000	0
2017/9/21 ~ 2017/12/20	379,536,000	25,848,000	353,688,000	0	0	22,000,000	0
2017/12/21 ~ 2018/3/20	353,688,000	25,848,000	327,840,000	0	0	22,000,000	0
2018/3/21 ~ 2018/6/20	327,840,000	25,848,000	301,992,000	0	0	22,000,000	0
2018/6/21 ~ 2018/9/20	301,992,000	25,848,000	276,144,000	0	0	22,000,000	0
2018/9/21 ~ 2018/12/20	276,144,000	25,848,000	250,296,000	0	0	22,000,000	0
2018/12/21 ~ 2019/3/20	250,296,000	25,848,000	224,448,000	0	0	22,000,000	0
2019/3/21 ~ 2019/6/20	224,448,000	25,848,000	198,600,000	0	0	22,000,000	0
2019/6/21 ~ 2019/9/20	198,600,000	25,848,000	172,752,000	0	0	22,000,000	0
2019/9/21 ~ 2019/12/20	172,752,000	25,848,000	146,904,000	0	0	22,000,000	0
2019/12/21 ~ 2020/3/23	146,904,000					22,000,000	0
2020/3/24 ~ 2020/6/22						22,000,000	0
2020/6/23 ~ 2020/9/23						22,000,000	0
2020/9/24 ~ 2020/12/21						22,000,000	0
2020/12/22 ~ 2021/4/30						22,000,000	0

富山信用金庫

プレミアム計算期間	参照債務残高 (開始日)	参照債務 減少額	参照債務残高 (末日)	デフォルト金額	累積ホートフォ デフォルト金額	免責金額	免責超過金額※2
2017/3/3 ~ 2017/6/20	931,000,000	19,380,000	911,620,000	0	0	30,000,000	0
2017/6/21 ~ 2017/9/20	911,620,000	58,140,000	853,480,000	0	0	30,000,000	0
2017/9/21 ~ 2017/12/20	853,480,000	58,140,000	795,340,000	0	0	30,000,000	0
2017/12/21 ~ 2018/3/20	795,340,000	70,020,000	725,320,000	0	0	30,000,000	0
2018/3/21 ~ 2018/6/20	725,320,000	79,079,000	646,241,000	0	0	30,000,000	0
2018/6/21 ~ 2018/9/20	646,241,000	62,001,000	584,240,000	0	0	30,000,000	0
2018/9/21 ~ 2018/12/20	584,240,000	54,705,000	529,535,000	0	0	30,000,000	0
2018/12/21 ~ 2019/3/20	529,535,000	54,705,000	474,830,000	0	0	30,000,000	0
2019/3/21 ~ 2019/6/20	474,830,000	54,705,000	420,125,000	0	0	30,000,000	0
2019/6/21 ~ 2019/9/20	420,125,000	54,705,000	365,420,000	0	0	30,000,000	0
2019/9/21 ~ 2019/12/20	365,420,000	54,705,000	310,715,000	0	0	30,000,000	0
2019/12/21 ~ 2020/3/23	310,715,000					30,000,000	0
2020/3/24 ~ 2020/6/22						30,000,000	0
2020/6/23 ~ 2020/9/23						30,000,000	0
2020/9/24 ~ 2020/12/21						30,000,000	0
2020/12/22 ~ 2021/4/30						30,000,000	0

「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)」発行後情報開示サマリー

(令和元年12月6日時点)

金沢信用金庫

プレミアム計算期間	参照債務残高 (開始日)	参照債務 減少額	参照債務残高 (末日)	デフォルト金額	累積ホートフォ デフォルト金額	免責金額	免責超過金額※2
2017/3/3 ~ 2017/6/20	1,300,000,000	27,064,000	1,272,936,000	0	0	73,000,000	0
2017/6/21 ~ 2017/9/20	1,272,936,000	81,192,000	1,191,744,000	0	0	73,000,000	0
2017/9/21 ~ 2017/12/20	1,191,744,000	81,192,000	1,110,552,000	0	0	73,000,000	0
2017/12/21 ~ 2018/3/20	1,110,552,000	81,192,000	1,029,360,000	0	0	73,000,000	0
2018/3/21 ~ 2018/6/20	1,029,360,000	124,955,000	904,405,000	0	0	73,000,000	0
2018/6/21 ~ 2018/9/20	904,405,000	84,117,000	820,288,000	0	0	73,000,000	0
2018/9/21 ~ 2018/12/20	820,288,000	76,821,000	743,467,000	0	0	73,000,000	0
2018/12/21 ~ 2019/3/20	743,467,000	76,821,000	666,646,000	0	0	73,000,000	0
2019/3/21 ~ 2019/6/20	666,646,000	76,821,000	589,825,000	0	0	73,000,000	0
2019/6/21 ~ 2019/9/20	589,825,000	82,050,000	507,775,000	0	0	73,000,000	0
2019/9/21 ~ 2019/12/20	507,775,000	95,384,000	412,391,000	23,975,000	23,975,000	73,000,000	0
2019/12/21 ~ 2020/3/23	412,391,000					73,000,000	
2020/3/24 ~ 2020/6/22						73,000,000	
2020/6/23 ~ 2020/9/23						73,000,000	
2020/9/24 ~ 2020/12/21						73,000,000	
2020/12/22 ~ 2021/4/30						73,000,000	

大阪信用金庫

プレミアム計算期間	参照債務残高 (開始日)	参照債務 減少額	参照債務残高 (末日)	デフォルト金額	累積ホートフォ デフォルト金額	免責金額	免責超過金額※2
2017/3/3 ~ 2017/6/20	975,000,000	20,289,000	954,711,000	0	0	37,000,000	0
2017/6/21 ~ 2017/9/20	954,711,000	88,367,000	866,344,000	0	0	37,000,000	0
2017/9/21 ~ 2017/12/20	866,344,000	58,992,000	807,352,000	0	0	37,000,000	0
2017/12/21 ~ 2018/3/20	807,352,000	58,576,000	748,776,000	0	0	37,000,000	0
2018/3/21 ~ 2018/6/20	748,776,000	74,000,000	674,776,000	8,336,000	8,336,000	37,000,000	0
2018/6/21 ~ 2018/9/20	674,776,000	61,917,000	612,859,000	0	8,336,000	37,000,000	0
2018/9/21 ~ 2018/12/20	612,859,000	63,693,000	549,166,000	0	8,336,000	37,000,000	0
2018/12/21 ~ 2019/3/20	549,166,000	53,061,000	496,105,000	0	8,336,000	37,000,000	0
2019/3/21 ~ 2019/6/20	496,105,000	53,061,000	443,044,000	0	8,336,000	37,000,000	0
2019/6/21 ~ 2019/9/20	443,044,000	53,061,000	389,983,000	0	8,336,000	37,000,000	0
2019/9/21 ~ 2019/12/20	389,983,000	60,581,000	329,402,000	0	8,336,000	37,000,000	0
2019/12/21 ~ 2020/3/23	329,402,000					37,000,000	
2020/3/24 ~ 2020/6/22						37,000,000	
2020/6/23 ~ 2020/9/23						37,000,000	
2020/9/24 ~ 2020/12/21						37,000,000	
2020/12/22 ~ 2021/4/30						37,000,000	

大阪シティ信用金庫

プレミアム計算期間	参照債務残高 (開始日)	参照債務 減少額	参照債務残高 (末日)	デフォルト金額	累積ホートフォ デフォルト金額	免責金額	免責超過金額※2
2017/3/3 ~ 2017/6/20	786,000,000	16,384,000	769,616,000	0	0	29,000,000	0
2017/6/21 ~ 2017/9/20	769,616,000	49,092,000	720,524,000	0	0	29,000,000	0
2017/9/21 ~ 2017/12/20	720,524,000	49,092,000	671,432,000	0	0	29,000,000	0
2017/12/21 ~ 2018/3/20	671,432,000	49,092,000	622,340,000	0	0	29,000,000	0
2018/3/21 ~ 2018/6/20	622,340,000	49,092,000	573,248,000	0	0	29,000,000	0
2018/6/21 ~ 2018/9/20	573,248,000	60,561,000	512,687,000	0	0	29,000,000	0
2018/9/21 ~ 2018/12/20	512,687,000	67,844,000	444,843,000	21,875,000	21,875,000	29,000,000	0
2018/12/21 ~ 2019/3/20	444,843,000	45,969,000	398,874,000	0	21,875,000	29,000,000	0
2019/3/21 ~ 2019/6/20	398,874,000	45,969,000	352,905,000	0	21,875,000	29,000,000	0
2019/6/21 ~ 2019/9/20	352,905,000	57,470,000	295,435,000	0	21,875,000	29,000,000	0
2019/9/21 ~ 2019/12/20	295,435,000	43,095,000	252,340,000	0	21,875,000	29,000,000	0
2019/12/21 ~ 2020/3/23	252,340,000					29,000,000	
2020/3/24 ~ 2020/6/22						29,000,000	
2020/6/23 ~ 2020/9/23						29,000,000	
2020/9/24 ~ 2020/12/21						29,000,000	
2020/12/22 ~ 2021/4/30						29,000,000	

姫路信用金庫

プレミアム計算期間	参照債務残高 (開始日)	参照債務 減少額	参照債務残高 (末日)	デフォルト金額	累積ホートフォ デフォルト金額	免責金額	免責超過金額※2
2017/3/3 ~ 2017/6/20	830,000,000	17,285,000	812,715,000	0	0	24,000,000	0
2017/6/21 ~ 2017/9/20	812,715,000	51,795,000	760,920,000	0	0	24,000,000	0
2017/9/21 ~ 2017/12/20	760,920,000	51,795,000	709,125,000	0	0	24,000,000	0
2017/12/21 ~ 2018/3/20	709,125,000	51,795,000	657,330,000	0	0	24,000,000	0
2018/3/21 ~ 2018/6/20	657,330,000	51,795,000	605,535,000	0	0	24,000,000	0
2018/6/21 ~ 2018/9/20	605,535,000	51,795,000	553,740,000	0	0	24,000,000	0
2018/9/21 ~ 2018/12/20	553,740,000	51,795,000	501,945,000	0	0	24,000,000	0
2018/12/21 ~ 2019/3/20	501,945,000	49,715,000	452,230,000	0	0	24,000,000	0
2019/3/21 ~ 2019/6/20	452,230,000	49,299,000	402,931,000	0	0	24,000,000	0
2019/6/21 ~ 2019/9/20	402,931,000	49,299,000	353,632,000	0	0	24,000,000	0
2019/9/21 ~ 2019/12/20	353,632,000	49,299,000	304,333,000	0	0	24,000,000	0
2019/12/21 ~ 2020/3/23	304,333,000					24,000,000	
2020/3/24 ~ 2020/6/22						24,000,000	
2020/6/23 ~ 2020/9/23						24,000,000	
2020/9/24 ~ 2020/12/21						24,000,000	
2020/12/22 ~ 2021/4/30						24,000,000	

西中国信用金庫

プレミアム計算期間	参照債務残高 (開始日)	参照債務 減少額	参照債務残高 (末日)	デフォルト金額	累積ホートフォ デフォルト金額	免責金額	免責超過金額※2
2017/3/3 ~ 2017/6/20	987,000,000	30,337,000	956,663,000	0	0	43,000,000	0
2017/6/21 ~ 2017/9/20	956,663,000	61,011,000	895,652,000	0	0	43,000,000	0
2017/9/21 ~ 2017/12/20	895,652,000	61,011,000	834,641,000	0	0	43,000,000	0
2017/12/21 ~ 2018/3/20	834,641,000	61,011,000	773,630,000	0	0	43,000,000	0
2018/3/21 ~ 2018/6/20	773,630,000	61,011,000	712,619,000	0	0	43,000,000	0
2018/6/21 ~ 2018/9/20	712,619,000	61,011,000	651,608,000	0	0	43,000,000	0
2018/9/21 ~ 2018/12/20	651,608,000	61,011,000	590,597,000	0	0	43,000,000	0
2018/12/21 ~ 2019/3/20	590,597,000	61,011,000	529,586,000	0	0	43,000,000	0
2019/3/21 ~ 2019/6/20	529,586,000	84,986,000	444,600,000	0	0	43,000,000	0
2019/6/21 ~ 2019/9/20	444,600,000	57,888,000	386,712,000	0	0	43,000,000	0
2019/9/21 ~ 2019/12/20	386,712,000	57,888,000	328,824,000	0	0	43,000,000	0
2019/12/21 ~ 2020/3/23	328,824,000					43,000,000	
2020/3/24 ~ 2020/6/22						43,000,000	
2020/6/23 ~ 2020/9/23						43,000,000	
2020/9/24 ~ 2020/12/21						43,000,000	
2020/12/22 ~ 2021/4/30						43,000,000	

「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)」発行後情報開示サマリー

(令和元年12月6日時点)

愛媛信用金庫

プレミアム計算期間	参照債務残高 (開始日)	参照債務 減少額	参照債務残高 (末日)	デフォルト金額	累積ポートフォリオ デフォルト金額	免責金額	免責超過金額※2
2017/3/3 ~ 2017/6/20	438,000,000	9,119,000	428,881,000	0	0	36,000,000	0
2017/6/21 ~ 2017/9/20	428,881,000	27,357,000	401,524,000	0	0	36,000,000	0
2017/9/21 ~ 2017/12/20	401,524,000	27,357,000	374,167,000	0	0	36,000,000	0
2017/12/21 ~ 2018/3/20	374,167,000	27,357,000	346,810,000	0	0	36,000,000	0
2018/3/21 ~ 2018/6/20	346,810,000	27,357,000	319,453,000	0	0	36,000,000	0
2018/6/21 ~ 2018/9/20	319,453,000	27,357,000	292,096,000	0	0	36,000,000	0
2018/9/21 ~ 2018/12/20	292,096,000	27,357,000	264,739,000	0	0	36,000,000	0
2018/12/21 ~ 2019/3/20	264,739,000	27,357,000	237,382,000	0	0	36,000,000	0
2019/3/21 ~ 2019/6/20	237,382,000	27,357,000	210,025,000	0	0	36,000,000	0
2019/6/21 ~ 2019/9/20	210,025,000	27,357,000	182,668,000	0	0	36,000,000	0
2019/9/21 ~ 2019/12/20	182,668,000	39,091,000	143,577,000	0	0	36,000,000	0
2019/12/21 ~ 2020/3/23	143,577,000					36,000,000	0
2020/3/24 ~ 2020/6/22						36,000,000	0
2020/6/23 ~ 2020/9/23						36,000,000	0
2020/9/24 ~ 2020/12/21						36,000,000	0
2020/12/22 ~ 2021/4/30						36,000,000	0

長野県信用組合

プレミアム計算期間	参照債務残高 (開始日)	参照債務 減少額	参照債務残高 (末日)	デフォルト金額	累積ポートフォリオ デフォルト金額	免責金額	免責超過金額※2
2017/3/3 ~ 2017/6/20	2,252,000,000	46,870,000	2,205,130,000	0	0	63,000,000	0
2017/6/21 ~ 2017/9/20	2,205,130,000	140,610,000	2,064,520,000	0	0	63,000,000	0
2017/9/21 ~ 2017/12/20	2,064,520,000	140,610,000	1,923,910,000	0	0	63,000,000	0
2017/12/21 ~ 2018/3/20	1,923,910,000	140,610,000	1,783,300,000	0	0	63,000,000	0
2018/3/21 ~ 2018/6/20	1,783,300,000	140,610,000	1,642,690,000	0	0	63,000,000	0
2018/6/21 ~ 2018/9/20	1,642,690,000	140,610,000	1,502,080,000	0	0	63,000,000	0
2018/9/21 ~ 2018/12/20	1,502,080,000	140,610,000	1,361,470,000	0	0	63,000,000	0
2018/12/21 ~ 2019/3/20	1,361,470,000	140,610,000	1,220,860,000	0	0	63,000,000	0
2019/3/21 ~ 2019/6/20	1,220,860,000	140,610,000	1,080,250,000	0	0	63,000,000	0
2019/6/21 ~ 2019/9/20	1,080,250,000	140,610,000	939,640,000	0	0	63,000,000	0
2019/9/21 ~ 2019/12/20	939,640,000	140,298,000	799,342,000	0	0	63,000,000	0
2019/12/21 ~ 2020/3/23	799,342,000					63,000,000	0
2020/3/24 ~ 2020/6/22						63,000,000	0
2020/6/23 ~ 2020/9/23						63,000,000	0
2020/9/24 ~ 2020/12/21						63,000,000	0
2020/12/22 ~ 2021/4/30						63,000,000	0

※2: 免責超過金額=累積ポートフォリオデフォルト金額-免責金額(但し、マイナスとなる場合は"0"と表示)

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)

業種別デフォルト分布

2019/12/06現在

(単位:百万円)

	合計			
	金額	比率	件数	比率
鉱業	0	0.0%	0	0.0%
建設業	80	20.5%	2	16.7%
製造業	50	12.8%	1	8.3%
電気・ガス・熱供給・水道業	0	0.0%	0	0.0%
情報通信業	0	0.0%	0	0.0%
運輸業	0	0.0%	0	0.0%
卸売・小売業	100	25.6%	4	33.3%
不動産業	0	0.0%	0	0.0%
飲食店、宿泊業	160	41.0%	5	41.7%
教育、学習支援業	0	0.0%	0	0.0%
サービス業(他に分類されないもの)	0	0.0%	0	0.0%
総計	390	100%	12	100%

	1 株式会社 七十七銀行				2 株式会社 清水銀行				3 株式会社 但馬銀行				4 株式会社 東日本銀行				5 株式会社 みなと銀行			
	金額	比率	件数	比率	金額	比率	件数	比率	金額	比率	件数	比率	金額	比率	件数	比率	金額	比率	件数	比率
鉱業	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
建設業	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
製造業	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	50	100.0%	1	100.0%
電気・ガス・熱供給・水道業	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
情報通信業	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
運輸業	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
卸売・小売業	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
不動産業	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
飲食店、宿泊業	130	100.0%	3	100.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
教育、学習支援業	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
サービス業(他に分類されないもの)	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
総計	130	100%	3	100%	0	0%	0	0%	0	0%	0	0%	0	0%	0	0%	50	100%	1	100%

	6 株式会社 福岡中央銀行				7 飯能信用金庫				8 朝日信用金庫				9 西武信用金庫				10 諏訪信用金庫			
	金額	比率	件数	比率	金額	比率	件数	比率	金額	比率	件数	比率	金額	比率	件数	比率	金額	比率	件数	比率
鉱業	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
建設業	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	30	30.0%	1	33.3%	0	0.0%	0	0.0%
製造業	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
電気・ガス・熱供給・水道業	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
情報通信業	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
運輸業	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
卸売・小売業	10	50.0%	1	50.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	50	50.0%	1	33.3%	0	0.0%	0	0.0%
不動産業	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
飲食店、宿泊業	10	50.0%	1	50.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	20	20.0%	1	33.3%	0	0.0%	0	0.0%
教育、学習支援業	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
サービス業(他に分類されないもの)	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
総計	20	100%	2	100%	0	0%	0	0%	0	0%	0	0%	100	100%	3	100%	0	0%	0	0%

注:金額は、当初貸付金額を指す(デフォルト時の残高ではない)。

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)

業種別デフォルト分布

2019/12/06現在

(単位:百万円)

	11 富山信用金庫				12 金沢信用金庫				13 大阪信用金庫				14 大阪シティ信用金庫				15 姫路信用金庫			
	金額	比率	件数	比率	金額	比率	件数	比率	金額	比率	件数	比率	金額	比率	件数	比率	金額	比率	件数	比率
鉱業	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
建設業	0	0.0%	0	0.0%	50	100.0%	1	100.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
製造業	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
電気・ガス・熱供給・水道業	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
情報通信業	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
運輸業	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
卸売・小売業	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	10	100.0%	1	100.0%	30	100.0%	1	100.0%	0	0.0%	0	0.0%
不動産業	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
飲食店、宿泊業	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
教育、学習支援業	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
サービス業(他に分類されないもの)	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
総計	0	0%	0	0%	50	100%	1	100%	10	100%	1	100%	30	100%	1	100%	0	0%	0	0%

	16 西中国信用金庫				17 愛媛信用金庫				18 長野県信用組合			
	金額	比率	件数	比率	金額	比率	件数	比率	金額	比率	件数	比率
鉱業	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
建設業	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
製造業	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
電気・ガス・熱供給・水道業	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
情報通信業	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
運輸業	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
卸売・小売業	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
不動産業	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
飲食店、宿泊業	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
教育、学習支援業	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
サービス業(他に分類されないもの)	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
総計	0	0%	0	0%	0	0%	0	0%	0	0%	0	0%

注:金額は、当初貸付金額を指す(デフォルト時の残高ではない)。

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)

貸付金額別デフォルト分布

2019/12/06現在

(単位:百万円)

		合計			
		金額	比率	件数	比率
10百万円以下		30	7.7%	3	25.0%
10百万円超 20百万円以下		20	5.1%	1	8.3%
20百万円超 30百万円以下		90	23.1%	3	25.0%
30百万円超 40百万円以下		0	0.0%	0	0.0%
40百万円超 50百万円以下		250	64.1%	5	41.7%
50百万円超 60百万円以下		0	0.0%	0	0.0%
60百万円超 70百万円以下		0	0.0%	0	0.0%
70百万円超 80百万円以下		0	0.0%	0	0.0%
80百万円超 90百万円以下		0	0.0%	0	0.0%
90百万円超 100百万円以下		0	0.0%	0	0.0%
100百万円超		0	0.0%	0	0.0%
総計		390	100%	12	100%

(単位:百万円)

		1 株式会社 七十七銀行				2 株式会社 清水銀行				3 株式会社 但馬銀行				4 株式会社 東日本銀行				5 株式会社 みなと銀行			
		金額	比率	件数	比率	金額	比率	件数	比率	金額	比率	件数	比率	金額	比率	件数	比率	金額	比率	件数	比率
10百万円以下		0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
10百万円超 20百万円以下		0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
20百万円超 30百万円以下		30	23.1%	1	33.3%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
30百万円超 40百万円以下		0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
40百万円超 50百万円以下		100	76.9%	2	66.7%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	50	100.0%	1	100.0%
50百万円超 60百万円以下		0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
60百万円超 70百万円以下		0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
70百万円超 80百万円以下		0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
80百万円超 90百万円以下		0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
90百万円超 100百万円以下		0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
100百万円超		0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
総計		130	100%	3	100%	0	0%	0	0%	0	0%	0	0%	0	0%	0	0%	50	100%	1	100%

(単位:百万円)

		6 株式会社 福岡中央銀行				7 飯能信用金庫				8 朝日信用金庫				9 西武信用金庫				10 諏訪信用金庫			
		金額	比率	件数	比率	金額	比率	件数	比率	金額	比率	件数	比率	金額	比率	件数	比率	金額	比率	件数	比率
10百万円以下		20	100.0%	2	100.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
10百万円超 20百万円以下		0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	20	20.0%	1	33.3%	0	0.0%	0	0.0%
20百万円超 30百万円以下		0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	30	30.0%	1	33.3%	0	0.0%	0	0.0%
30百万円超 40百万円以下		0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
40百万円超 50百万円以下		0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	50	50.0%	1	33.3%	0	0.0%	0	0.0%
50百万円超 60百万円以下		0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
60百万円超 70百万円以下		0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
70百万円超 80百万円以下		0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
80百万円超 90百万円以下		0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
90百万円超 100百万円以下		0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
100百万円超		0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
総計		20	100%	2	100%	0	0%	0	0%	0	0%	0	0%	100	100%	3	100%	0	0%	0	0%

注:金額は、当初貸付金額を指す(デフォルト時の残高ではない)。

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)

貸付金額別デフォルト分布

2019/12/06現在

(単位:百万円)

	11 富山信用金庫				12 金沢信用金庫				13 大阪信用金庫				14 大阪シティ信用金庫				15 姫路信用金庫			
	金額	比率	件数	比率	金額	比率	件数	比率	金額	比率	件数	比率	金額	比率	件数	比率	金額	比率	件数	比率
10百万円以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	10	100.0%	1	100.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
10百万円超 20百万円以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
20百万円超 30百万円以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	30	100.0%	1	100.0%	0	0.0%	0	0.0%
30百万円超 40百万円以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
40百万円超 50百万円以下	0	0.0%	0	0.0%	50	100.0%	1	100.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
50百万円超 60百万円以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
60百万円超 70百万円以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
70百万円超 80百万円以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
80百万円超 90百万円以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
90百万円超 100百万円以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
100百万円超	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
総計	0	0%	0	0%	50	100%	1	100%	10	100%	1	100%	30	100%	1	100%	0	0%	0	0%

	16 西中国信用金庫				17 愛媛信用金庫				18 長野県信用組合			
	金額	比率	件数	比率	金額	比率	件数	比率	金額	比率	件数	比率
10百万円以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
10百万円超 20百万円以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
20百万円超 30百万円以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
30百万円超 40百万円以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
40百万円超 50百万円以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
50百万円超 60百万円以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
60百万円超 70百万円以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
70百万円超 80百万円以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
80百万円超 90百万円以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
90百万円超 100百万円以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
100百万円超	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
総計	0	0%	0	0%	0	0%	0	0%	0	0%	0	0%

注:金額は、当初貸付金額を指す(デフォルト時の残高ではない)。

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)

2019/12/06現在

CRDモデル3 累積1年デフォルト確率別デフォルト分布
(単位:百万円)

		合計			
		金額	比率	件数	比率
0.1%以下		60	15.4%	3	25.0%
0.1%超 0.2%以下		30	7.7%	1	8.3%
0.2%超 0.3%以下		60	15.4%	2	16.7%
0.3%超 0.4%以下		50	12.8%	1	8.3%
0.4%超 0.5%以下		50	12.8%	1	8.3%
0.5%超 0.6%以下		100	25.6%	2	16.7%
0.6%超 0.7%以下		40	10.3%	2	16.7%
0.7%超 0.8%以下		0	0.0%	0	0.0%
0.8%超 0.9%以下		0	0.0%	0	0.0%
0.9%超 1.0%以下		0	0.0%	0	0.0%
1.0%超 1.1%以下		0	0.0%	0	0.0%
1.1%超 1.2%以下		0	0.0%	0	0.0%
1.2%超 1.3%以下		0	0.0%	0	0.0%
1.3%超 1.4%以下		0	0.0%	0	0.0%
1.4%超 1.5%以下		0	0.0%	0	0.0%
1.5%超 1.6%以下		0	0.0%	0	0.0%
1.6%超 1.7%以下		0	0.0%	0	0.0%
1.7%超 1.8%以下		0	0.0%	0	0.0%
1.8%超 1.9%以下		0	0.0%	0	0.0%
1.9%超 2.0%以下		0	0.0%	0	0.0%
2.0%超		0	0.0%	0	0.0%
総計		390	100%	12	100%

		1 株式会社 七十七銀行				2 株式会社 清水銀行				3 株式会社 但馬銀行				4 株式会社 東日本銀行				5 株式会社 みなと銀行			
		金額	比率	件数	比率	金額	比率	件数	比率	金額	比率	件数	比率	金額	比率	件数	比率	金額	比率	件数	比率
0.1%以下		0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
0.1%超 0.2%以下		30	23.1%	1	33.3%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
0.2%超 0.3%以下		0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
0.3%超 0.4%以下		0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
0.4%超 0.5%以下		50	38.5%	1	33.3%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
0.5%超 0.6%以下		50	38.5%	1	33.3%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	50	100.0%	1	100.0%	0	0.0%
0.6%超 0.7%以下		0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
0.7%超 0.8%以下		0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
0.8%超 0.9%以下		0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
0.9%超 1.0%以下		0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
1.0%超 1.1%以下		0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
1.1%超 1.2%以下		0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
1.2%超 1.3%以下		0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
1.3%超 1.4%以下		0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
1.4%超 1.5%以下		0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
1.5%超 1.6%以下		0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
1.6%超 1.7%以下		0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
1.7%超 1.8%以下		0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
1.8%超 1.9%以下		0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
1.9%超 2.0%以下		0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
2.0%超		0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
総計		130	100%	3	100%	0	0%	0	0%	0	0%	0	0%	0	0%	50	100%	1	100%	0	0%

注:金額は、当初貸付金額を指す(デフォルト時の残高ではない)。

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)

CRDモデル3 累積1年デフォルト確率別デフォルト分布

2019/12/06現在

	6				7				8				9				10 (単位:百万円)			
	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									
	金額	比率	件数	比率	金額	比率	件数	比率	金額	比率	件数	比率	金額	比率	件数	比率	金額	比率	件数	比率
0.1%以下	10	50.0%	1	50.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	20	20.0%	1	33.3%	0	0.0%	0	0.0%
0.1%超 0.2%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
0.2%超 0.3%以下	10	50.0%	1	50.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
0.3%超 0.4%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	50	50.0%	1	33.3%	0	0.0%	0	0.0%
0.4%超 0.5%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
0.5%超 0.6%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
0.6%超 0.7%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	30	30.0%	1	33.3%	0	0.0%	0	0.0%
0.7%超 0.8%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
0.8%超 0.9%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
0.9%超 1.0%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
1.0%超 1.1%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
1.1%超 1.2%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
1.2%超 1.3%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
1.3%超 1.4%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
1.4%超 1.5%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
1.5%超 1.6%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
1.6%超 1.7%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
1.7%超 1.8%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
1.8%超 1.9%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
1.9%超 2.0%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
2.0%超	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
総計	20	100%	2	100%	0	0%	0	0%	0	0%	0	0%	100	100%	3	100%	0	0%	0	0%

	11				12				13				14				15 (単位:百万円)			
	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			
	金額	比率	件数	比率	金額	比率	件数	比率	金額	比率	件数	比率	金額	比率	件数	比率	金額	比率	件数	比率
0.1%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	30	100.0%	1	100.0%	0	0.0%	0	0.0%
0.1%超 0.2%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
0.2%超 0.3%以下	0	0.0%	0	0.0%	50	100.0%	1	100.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
0.3%超 0.4%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
0.4%超 0.5%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
0.5%超 0.6%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
0.6%超 0.7%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	10	100.0%	1	100.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
0.7%超 0.8%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
0.8%超 0.9%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
0.9%超 1.0%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
1.0%超 1.1%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
1.1%超 1.2%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
1.2%超 1.3%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
1.3%超 1.4%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
1.4%超 1.5%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
1.5%超 1.6%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
1.6%超 1.7%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
1.7%超 1.8%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
1.8%超 1.9%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
1.9%超 2.0%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
2.0%超	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
総計	0	0%	0	0%	50	100%	1	100%	10	100%	1	100%	30	100%	1	100%	0	0%	0	0%

注:金額は、当初貸付金額を指す(デフォルト時の残高ではない)。

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)

CRDモデル3 累積1年デフォルト確率別デフォルト分布

2019/12/06現在

		16				17				18 (単位:百万円)			
		西中国信用金庫				愛媛信用金庫				長野県信用組合			
		金額	比率	件数	比率	金額	比率	件数	比率	金額	比率	件数	比率
0.1%以下		0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
0.1%超	0.2%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
0.2%超	0.3%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
0.3%超	0.4%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
0.4%超	0.5%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
0.5%超	0.6%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
0.6%超	0.7%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
0.7%超	0.8%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
0.8%超	0.9%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
0.9%超	1.0%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
1.0%超	1.1%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
1.1%超	1.2%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
1.2%超	1.3%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
1.3%超	1.4%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
1.4%超	1.5%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
1.5%超	1.6%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
1.6%超	1.7%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
1.7%超	1.8%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
1.8%超	1.9%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
1.9%超	2.0%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
2.0%超		0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
総計		0	0%	0	0%	0	0%	0	0%	0	0%	0	0%

注:金額は、当初貸付金額を指す(デフォルト時の残高ではない)。

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)

RDB中小企業クレジットモデルデフォルト確率別デフォルト分布
(単位:百万円)

2019/12/06現在

合計		金額	比率	件数	比率
0.1%以下		0	0.0%	0	0.0%
0.1%超 0.2%以下		0	0.0%	0	0.0%
0.2%超 0.3%以下		0	0.0%	0	0.0%
0.3%超 0.4%以下		50	12.8%	1	8.3%
0.4%超 0.5%以下		0	0.0%	0	0.0%
0.5%超 0.6%以下		30	7.7%	1	8.3%
0.6%超 0.7%以下		20	5.1%	1	8.3%
0.7%超 0.8%以下		50	12.8%	1	8.3%
0.8%超 0.9%以下		0	0.0%	0	0.0%
0.9%超 1.0%以下		10	2.6%	1	8.3%
1.0%超 1.1%以下		10	2.6%	1	8.3%
1.1%超 1.2%以下		30	7.7%	1	8.3%
1.2%超 1.3%以下		0	0.0%	0	0.0%
1.3%超 1.4%以下		0	0.0%	0	0.0%
1.4%超 1.5%以下		60	15.4%	2	16.7%
1.5%超 1.6%以下		0	0.0%	0	0.0%
1.6%超 1.7%以下		0	0.0%	0	0.0%
1.7%超 1.8%以下		0	0.0%	0	0.0%
1.8%超 1.9%以下		0	0.0%	0	0.0%
1.9%超 2.0%以下		0	0.0%	0	0.0%
2.0%超		130	33.3%	3	25.0%
総計		390	100%	12	100%

	1 株式会社 七十七銀行				2 株式会社 清水銀行				3 株式会社 但馬銀行				4 株式会社 東日本銀行				5 株式会社 みなと銀行			
	金額	比率	件数	比率	金額	比率	件数	比率	金額	比率	件数	比率	金額	比率	件数	比率	金額	比率	件数	比率
0.1%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
0.1%超 0.2%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
0.2%超 0.3%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
0.3%超 0.4%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
0.4%超 0.5%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
0.5%超 0.6%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
0.6%超 0.7%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
0.7%超 0.8%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	50	100.0%	1	100.0%
0.8%超 0.9%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
0.9%超 1.0%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
1.0%超 1.1%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
1.1%超 1.2%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
1.2%超 1.3%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
1.3%超 1.4%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
1.4%超 1.5%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
1.5%超 1.6%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
1.6%超 1.7%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
1.7%超 1.8%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
1.8%超 1.9%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
1.9%超 2.0%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
2.0%超	130	100.0%	3	100.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
総計	130	100%	3	100%	0	0%	0	0%	0	0%	0	0%	0	0%	0	0%	50	100%	1	100%

注:金額は、当初貸付金額を指す(デフォルト時の残高ではない)。

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)

RDB中小企業クレジットモデルデフォルト確率別デフォルト分布

2019/12/06現在

(単位:百万円)

	6 株式会社 福岡中央銀行				7 飯能信用金庫				8 朝日信用金庫				9 西武信用金庫				10 諏訪信用金庫					
	金額	比率	件数	比率	金額	比率	件数	比率	金額	比率	件数	比率	金額	比率	件数	比率	金額	比率	件数	比率		
0.1%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
0.1%超 0.2%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
0.2%超 0.3%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
0.3%超 0.4%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
0.4%超 0.5%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
0.5%超 0.6%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
0.6%超 0.7%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	20	20.0%	1	33.3%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
0.7%超 0.8%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
0.8%超 0.9%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
0.9%超 1.0%以下	10	50.0%	1	50.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
1.0%超 1.1%以下	10	50.0%	1	50.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
1.1%超 1.2%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	30	30.0%	1	33.3%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
1.2%超 1.3%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
1.3%超 1.4%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
1.4%超 1.5%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	50	50.0%	1	33.3%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
1.5%超 1.6%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
1.6%超 1.7%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
1.7%超 1.8%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
1.8%超 1.9%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
1.9%超 2.0%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
2.0%超	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
総計	20	100%	2	100%	0	0%	0	0%	0	0%	0	0%	100	100%	3	100%	0	0%	0	0%	0	0%

	11 富山信用金庫				12 金沢信用金庫				13 大阪信用金庫				14 大阪シティ信用金庫				15 姫路信用金庫					
	金額	比率	件数	比率	金額	比率	件数	比率	金額	比率	件数	比率	金額	比率	件数	比率	金額	比率	件数	比率		
0.1%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
0.1%超 0.2%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
0.2%超 0.3%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
0.3%超 0.4%以下	0	0.0%	0	0.0%	50	100.0%	1	100.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
0.4%超 0.5%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
0.5%超 0.6%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	30	100.0%	1	100.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
0.6%超 0.7%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
0.7%超 0.8%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
0.8%超 0.9%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
0.9%超 1.0%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
1.0%超 1.1%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
1.1%超 1.2%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
1.2%超 1.3%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
1.3%超 1.4%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
1.4%超 1.5%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	10	100.0%	1	100.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
1.5%超 1.6%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
1.6%超 1.7%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
1.7%超 1.8%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
1.8%超 1.9%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
1.9%超 2.0%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
2.0%超	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
総計	0	0%	0	0%	50	100%	1	100%	10	100%	1	100%	30	100%	1	100%	0	0%	0	0%	0	0%

注:金額は、当初貸付金額を指す(デフォルト時の残高ではない)。

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)

RDB中小企業クレジットモデルデフォルト確率別デフォルト分布

2019/12/06現在

		16				17				18				(単位:百万円)	
		西中国信用金庫		愛媛信用金庫		長野県信用組合									
		金額	比率	件数	比率	金額	比率	件数	比率	金額	比率	件数	比率	金額	比率
0.1%以下		0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
0.1%超 0.2%以下		0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
0.2%超 0.3%以下		0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
0.3%超 0.4%以下		0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
0.4%超 0.5%以下		0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
0.5%超 0.6%以下		0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
0.6%超 0.7%以下		0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
0.7%超 0.8%以下		0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
0.8%超 0.9%以下		0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
0.9%超 1.0%以下		0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
1.0%超 1.1%以下		0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
1.1%超 1.2%以下		0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
1.2%超 1.3%以下		0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
1.3%超 1.4%以下		0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
1.4%超 1.5%以下		0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
1.5%超 1.6%以下		0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
1.6%超 1.7%以下		0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
1.7%超 1.8%以下		0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
1.8%超 1.9%以下		0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
1.9%超 2.0%以下		0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
2.0%超		0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
総計		0	0%	0	0%	0	0%	0	0%	0	0%	0	0%	0	0%

注:金額は、当初貸付金額を指す(デフォルト時の残高ではない)。

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)

リスクカルク日本版v3.1デフォルト確率別デフォルト分布
(単位:百万円)

2019/12/06現在

		合計			
		金額	比率	件数	比率
0.1%以下		0	0.0%	0	0.0%
0.1%超 0.2%以下		30	7.7%	1	8.3%
0.2%超 0.3%以下		80	20.5%	3	25.0%
0.3%超 0.4%以下		50	12.8%	1	8.3%
0.4%超 0.5%以下		60	15.4%	2	16.7%
0.5%超 0.6%以下		30	7.7%	1	8.3%
0.6%超 0.7%以下		60	15.4%	2	16.7%
0.7%超 0.8%以下		0	0.0%	0	0.0%
0.8%超 0.9%以下		0	0.0%	0	0.0%
0.9%超 1.0%以下		50	12.8%	1	8.3%
1.0%超 1.1%以下		0	0.0%	0	0.0%
1.1%超 1.2%以下		0	0.0%	0	0.0%
1.2%超 1.3%以下		0	0.0%	0	0.0%
1.3%超 1.4%以下		0	0.0%	0	0.0%
1.4%超 1.5%以下		30	7.7%	1	8.3%
1.5%超 1.6%以下		0	0.0%	0	0.0%
1.6%超 1.7%以下		0	0.0%	0	0.0%
1.7%超 1.8%以下		0	0.0%	0	0.0%
1.8%超 1.9%以下		0	0.0%	0	0.0%
1.9%超 2.0%以下		0	0.0%	0	0.0%
2.0%超		0	0.0%	0	0.0%
総計		390	100%	12	100%

		1 株式会社 七十七銀行				2 株式会社 清水銀行				3 株式会社 但馬銀行				4 株式会社 東日本銀行				5 株式会社 みなと銀行			
		金額	比率	件数	比率	金額	比率	件数	比率	金額	比率	件数	比率	金額	比率	件数	比率	金額	比率	件数	比率
0.1%以下		0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
0.1%超 0.2%以下		0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
0.2%超 0.3%以下		0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
0.3%超 0.4%以下		0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
0.4%超 0.5%以下		0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	50	100.0%	1	100.0%
0.5%超 0.6%以下		0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
0.6%超 0.7%以下		50	38.5%	1	33.3%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
0.7%超 0.8%以下		0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
0.8%超 0.9%以下		0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
0.9%超 1.0%以下		50	38.5%	1	33.3%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
1.0%超 1.1%以下		0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
1.1%超 1.2%以下		0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
1.2%超 1.3%以下		0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
1.3%超 1.4%以下		0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
1.4%超 1.5%以下		30	23.1%	1	33.3%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
1.5%超 1.6%以下		0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
1.6%超 1.7%以下		0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
1.7%超 1.8%以下		0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
1.8%超 1.9%以下		0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
1.9%超 2.0%以下		0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
2.0%超		0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
総計		130	100%	3	100%	0	0%	0	0%	0	0%	0	0%	0	0%	0	0%	50	100%	1	100%

注:金額は、当初貸付金額を指す(デフォルト時の残高ではない)。

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)

リスクカルク日本版v3.1デフォルト確率別デフォルト分布

2019/12/06現在

(単位:百万円)

	6 株式会社 福岡中央銀行				7 飯能信用金庫				8 朝日信用金庫				9 西武信用金庫				10 諏訪信用金庫			
	金額	比率	件数	比率	金額	比率	件数	比率	金額	比率	件数	比率	金額	比率	件数	比率	金額	比率	件数	比率
0.1%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
0.1%超 0.2%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
0.2%超 0.3%以下	10	50.0%	1	50.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	20	20.0%	1	33.3%	0	0.0%	0	0.0%
0.3%超 0.4%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	50	50.0%	1	33.3%	0	0.0%	0	0.0%
0.4%超 0.5%以下	10	50.0%	1	50.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
0.5%超 0.6%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	30	30.0%	1	33.3%	0	0.0%	0	0.0%
0.6%超 0.7%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
0.7%超 0.8%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
0.8%超 0.9%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
0.9%超 1.0%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
1.0%超 1.1%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
1.1%超 1.2%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
1.2%超 1.3%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
1.3%超 1.4%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
1.4%超 1.5%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
1.5%超 1.6%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
1.6%超 1.7%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
1.7%超 1.8%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
1.8%超 1.9%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
1.9%超 2.0%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
2.0%超	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
総計	20	100%	2	100%	0	0%	0	0%	0	0%	0	0%	100	100%	3	100%	0	0%	0	0%

	11 富山信用金庫				12 金沢信用金庫				13 大阪信用金庫				14 大阪シティ信用金庫				15 姫路信用金庫			
	金額	比率	件数	比率	金額	比率	件数	比率	金額	比率	件数	比率	金額	比率	件数	比率	金額	比率	件数	比率
0.1%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
0.1%超 0.2%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	30	100.0%	1	100.0%	0	0.0%	0	0.0%
0.2%超 0.3%以下	0	0.0%	0	0.0%	50	100.0%	1	100.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
0.3%超 0.4%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
0.4%超 0.5%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
0.5%超 0.6%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
0.6%超 0.7%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	10	100.0%	1	100.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
0.7%超 0.8%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
0.8%超 0.9%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
0.9%超 1.0%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
1.0%超 1.1%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
1.1%超 1.2%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
1.2%超 1.3%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
1.3%超 1.4%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
1.4%超 1.5%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
1.5%超 1.6%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
1.6%超 1.7%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
1.7%超 1.8%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
1.8%超 1.9%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
1.9%超 2.0%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
2.0%超	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
総計	0	0%	0	0%	50	100%	1	100%	10	100%	1	100%	30	100%	1	100%	0	0%	0	0%

注:金額は、当初貸付金額を指す(デフォルト時の残高ではない)。

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)

リスクカルク日本版v3.1デフォルト確率別デフォルト分布

2019/12/06現在

		16				17				18				(単位:百万円)	
		西中国信用金庫				愛媛信用金庫				長野県信用組合					
		金額	比率	件数	比率	金額	比率	件数	比率	金額	比率	件数	比率		
0.1%以下		0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%		
0.1%超	0.2%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%		
0.2%超	0.3%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%		
0.3%超	0.4%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%		
0.4%超	0.5%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%		
0.5%超	0.6%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%		
0.6%超	0.7%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%		
0.7%超	0.8%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%		
0.8%超	0.9%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%		
0.9%超	1.0%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%		
1.0%超	1.1%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%		
1.1%超	1.2%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%		
1.2%超	1.3%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%		
1.3%超	1.4%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%		
1.4%超	1.5%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%		
1.5%超	1.6%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%		
1.6%超	1.7%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%		
1.7%超	1.8%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%		
1.8%超	1.9%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%		
1.9%超	2.0%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%		
2.0%超		0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%		
総計		0	0%	0	0%	0	0%	0	0%	0	0%	0	0%		

注:金額は、当初貸付金額を指す(デフォルト時の残高ではない)。

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)

2019/12/06現在

CRITSデフォルト確率別デフォルト分布

(単位:百万円)

		合計			
		金額	比率	件数	比率
0.1%以下		0	0.0%	0	0.0%
0.1%超 0.2%以下		0	0.0%	0	0.0%
0.2%超 0.3%以下		0	0.0%	0	0.0%
0.3%超 0.4%以下		0	0.0%	0	0.0%
0.4%超 0.5%以下		20	5.1%	1	8.3%
0.5%超 0.6%以下		30	7.7%	1	8.3%
0.6%超 0.7%以下		50	12.8%	1	8.3%
0.7%超 0.8%以下		70	17.9%	3	25.0%
0.8%超 0.9%以下		30	7.7%	1	8.3%
0.9%超 1.0%以下		50	12.8%	1	8.3%
1.0%超 1.1%以下		50	12.8%	1	8.3%
1.1%超 1.2%以下		0	0.0%	0	0.0%
1.2%超 1.3%以下		80	20.5%	2	16.7%
1.3%超 1.4%以下		0	0.0%	0	0.0%
1.4%超 1.5%以下		0	0.0%	0	0.0%
1.5%超 1.6%以下		0	0.0%	0	0.0%
1.6%超 1.7%以下		0	0.0%	0	0.0%
1.7%超 1.8%以下		0	0.0%	0	0.0%
1.8%超 1.9%以下		10	2.6%	1	8.3%
1.9%超 2.0%以下		0	0.0%	0	0.0%
2.0%超		0	0.0%	0	0.0%
総計		390	100%	12	100%

		1 株式会社 七十七銀行				2 株式会社 清水銀行				3 株式会社 但馬銀行				4 株式会社 東日本銀行				5 株式会社 みなと銀行			
		金額	比率	件数	比率	金額	比率	件数	比率	金額	比率	件数	比率	金額	比率	件数	比率	金額	比率	件数	比率
0.1%以下		0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
0.1%超 0.2%以下		0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
0.2%超 0.3%以下		0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
0.3%超 0.4%以下		0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
0.4%超 0.5%以下		0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
0.5%超 0.6%以下		0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
0.6%超 0.7%以下		0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	50	100.0%	1	100.0%
0.7%超 0.8%以下		0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
0.8%超 0.9%以下		30	23.1%	1	33.3%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
0.9%超 1.0%以下		50	38.5%	1	33.3%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
1.0%超 1.1%以下		0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
1.1%超 1.2%以下		0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
1.2%超 1.3%以下		50	38.5%	1	33.3%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
1.3%超 1.4%以下		0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
1.4%超 1.5%以下		0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
1.5%超 1.6%以下		0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
1.6%超 1.7%以下		0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
1.7%超 1.8%以下		0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
1.8%超 1.9%以下		0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
1.9%超 2.0%以下		0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
2.0%超		0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
総計		130	100%	3	100%	0	0%	0	0%	0	0%	0	0%	0	0%	0	0%	50	100%	1	100%

注:金額は、当初貸付金額を指す(デフォルト時の残高ではない)。

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)

CRITSデフォルト確率別デフォルト分布

2019/12/06現在

(単位:百万円)

	6 株式会社 福岡中央銀行				7 飯能信用金庫				8 朝日信用金庫				9 西武信用金庫				10 諏訪信用金庫			
	金額	比率	件数	比率	金額	比率	件数	比率	金額	比率	件数	比率	金額	比率	件数	比率	金額	比率	件数	比率
0.1%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
0.1%超 0.2%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
0.2%超 0.3%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
0.3%超 0.4%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
0.4%超 0.5%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	20	20.0%	1	33.3%	0	0.0%	0	0.0%
0.5%超 0.6%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
0.6%超 0.7%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
0.7%超 0.8%以下	20	100.0%	2	100.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	50	50.0%	1	33.3%	0	0.0%	0	0.0%
0.8%超 0.9%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
0.9%超 1.0%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
1.0%超 1.1%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
1.1%超 1.2%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
1.2%超 1.3%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	30	30.0%	1	33.3%	0	0.0%	0	0.0%
1.3%超 1.4%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
1.4%超 1.5%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
1.5%超 1.6%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
1.6%超 1.7%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
1.7%超 1.8%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
1.8%超 1.9%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
1.9%超 2.0%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
2.0%超	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
総計	20	100%	2	100%	0	0%	0	0%	0	0%	0	0%	100	100%	3	100%	0	0%	0	0%

	11 富山信用金庫				12 金沢信用金庫				13 大阪信用金庫				14 大阪シティ信用金庫				15 姫路信用金庫			
	金額	比率	件数	比率	金額	比率	件数	比率	金額	比率	件数	比率	金額	比率	件数	比率	金額	比率	件数	比率
0.1%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
0.1%超 0.2%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
0.2%超 0.3%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
0.3%超 0.4%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
0.4%超 0.5%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
0.5%超 0.6%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	30	100.0%	1	100.0%	0	0.0%	0	0.0%
0.6%超 0.7%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
0.7%超 0.8%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
0.8%超 0.9%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
0.9%超 1.0%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
1.0%超 1.1%以下	0	0.0%	0	0.0%	50	100.0%	1	100.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
1.1%超 1.2%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
1.2%超 1.3%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
1.3%超 1.4%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
1.4%超 1.5%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
1.5%超 1.6%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
1.6%超 1.7%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
1.7%超 1.8%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
1.8%超 1.9%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	10	100.0%	1	100.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
1.9%超 2.0%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
2.0%超	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
総計	0	0%	0	0%	50	100%	1	100%	10	100%	1	100%	30	100%	1	100%	0	0%	0	0%

注:金額は、当初貸付金額を指す(デフォルト時の残高ではない)。

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)

CRITSデフォルト確率別デフォルト分布

2019/12/06現在

		16				17				18				(単位:百万円)	
		西中国信用金庫				愛媛信用金庫				長野県信用組合					
		金額	比率	件数	比率	金額	比率	件数	比率	金額	比率	件数	比率		
0.1%以下		0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%		
0.1%超	0.2%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%		
0.2%超	0.3%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%		
0.3%超	0.4%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%		
0.4%超	0.5%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%		
0.5%超	0.6%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%		
0.6%超	0.7%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%		
0.7%超	0.8%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%		
0.8%超	0.9%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%		
0.9%超	1.0%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%		
1.0%超	1.1%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%		
1.1%超	1.2%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%		
1.2%超	1.3%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%		
1.3%超	1.4%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%		
1.4%超	1.5%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%		
1.5%超	1.6%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%		
1.6%超	1.7%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%		
1.7%超	1.8%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%		
1.8%超	1.9%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%		
1.9%超	2.0%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%		
2.0%超		0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%		
総計		0	0%	0	0%	0	0%	0	0%	0	0%	0	0%		

注:金額は、当初貸付金額を指す(デフォルト時の残高ではない)。

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)

デフォルト債権及び延滞債権一覧

2019/12/06現在

取扱金融機関	業種	クレジットイベント事由等(注1)	事由発生日	デフォルト金額 確定日(注2)	参照債務残高 (注3)	デフォルト認 定金額(注3)	当初元本
株式会社 七十七銀行	卸売・小売業	延滞	2017/8/21	未確定	45,836,000	0	50,000,000
株式会社 七十七銀行	飲食店、宿泊業	法的破綻等(民事再生手続開始)	2019/3/14	2019/4/22	16,250,000	16,250,000	30,000,000
株式会社 七十七銀行	飲食店、宿泊業	期限の利益喪失	2019/6/20	2019/7/31	31,262,000	31,262,000	50,000,000
株式会社 七十七銀行	飲食店、宿泊業	期限の利益喪失	2019/6/20	2019/7/31	31,262,000	31,262,000	50,000,000
株式会社 但馬銀行	サービス業(他に分類 されないもの)	延滞	2018/9/20	未確定	19,375,000	0	30,000,000
株式会社 東日本銀行	卸売・小売業	延滞	2017/11/20	未確定	42,713,000	0	50,000,000
株式会社 東日本銀行	建設業	延滞	2019/9/20	未確定	11,875,000	0	30,000,000
株式会社 みなと銀行	飲食店、宿泊業	延滞	2018/4/20	未確定	37,508,000	0	50,000,000
株式会社 みなと銀行	卸売・小売業	延滞	2018/6/20	未確定	21,250,000	0	30,000,000
株式会社 みなと銀行	卸売・小売業	延滞	2018/10/22	未確定	28,134,000	0	45,000,000
株式会社 みなと銀行	運輸業	延滞	2018/10/22	未確定	18,750,000	0	30,000,000
株式会社 みなと銀行	運輸業	延滞	2018/11/20	未確定	30,221,000	0	50,000,000
株式会社 みなと銀行	製造業	法的破綻等(破産手続開始)	2019/1/16	2019/2/6	33,344,000	33,344,000	50,000,000
株式会社 みなと銀行	卸売・小売業	延滞	2019/1/21	未確定	28,139,000	0	50,000,000
株式会社 みなと銀行	卸売・小売業	延滞	2019/3/20	未確定	10,432,000	0	20,000,000
株式会社 みなと銀行	サービス業(他に分類 されないもの)	延滞	2019/7/22	未確定	4,384,000	0	10,000,000
株式会社 福岡中央銀行	卸売・小売業	延滞	2017/12/20	未確定	25,000,000	0	30,000,000

注1: クレジットイベント事由等には延滞債権も含まれる。延滞とは、延滞通知が提出されており参照債務残高の減額が停止しているもの。

注2: 未確定とは、クレジットイベントが確定していないもの。

注3: 参照債務残高とデフォルト認定金額との差異は、部分償還ないし預金相殺等による一部入金の結果生じたもの。

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)

デフォルト債権及び延滞債権一覧

2019/12/06現在

取扱金融機関	業種	クレジットイベント事由等(注1)	事由発生日	デフォルト金額 確定日(注2)	参照債務残高 (注3)	デフォルト認 定金額(注3)	当初元本
株式会社 福岡中央銀行	卸売・小売業	支払不履行	2018/8/20	2018/9/10	7,296,000	7,296,000	10,000,000
株式会社 福岡中央銀行	情報通信業	延滞	2018/8/20	未確定	6,672,000	0	10,000,000
株式会社 福岡中央銀行	飲食店、宿泊業	法的破綻等(破産手続開始)	2018/9/3	2018/10/18	7,088,000	7,088,000	10,000,000
株式会社 福岡中央銀行	サービス業(他に分類 されないもの)	延滞	2019/5/20	未確定	4,800,000	0	10,000,000
株式会社 福岡中央銀行	建設業	延滞	2019/10/21	未確定	11,250,000	0	30,000,000
飯能信用金庫	卸売・小売業	延滞	2018/2/20	未確定	7,920,000	0	10,000,000
西武信用金庫	卸売・小売業	延滞	2017/9/20	未確定	44,795,000	0	50,000,000
西武信用金庫	情報通信業	延滞	2018/4/20	未確定	37,508,000	0	50,000,000
西武信用金庫	建設業	法的破綻等(民事再生手続開始)	2019/2/1	2019/2/22	16,250,000	16,250,000	30,000,000
西武信用金庫	情報通信業	延滞	2019/3/20	未確定	26,057,000	0	50,000,000
西武信用金庫	飲食店、宿泊業	法的破綻等(民事再生手続開始)	2019/3/27	2019/4/22	10,432,000	10,432,000	20,000,000
西武信用金庫	卸売・小売業	支払不履行	2019/5/20	2019/10/1	27,098,000	27,098,000	50,000,000
金沢信用金庫	建設業	法的破綻等(その他)	2019/9/2	2019/10/11	23,975,000	23,975,000	50,000,000
金沢信用金庫	製造業	延滞	2019/10/21	未確定	18,770,000	0	50,000,000
大阪信用金庫	卸売・小売業	法的破綻等(破産手続開始)	2018/3/16	2018/4/18	8,336,000	8,336,000	10,000,000
大阪信用金庫	建設業	延滞	2018/5/21	未確定	29,171,000	0	40,000,000
大阪信用金庫	卸売・小売業	延滞	2018/11/20	未確定	6,048,000	0	10,000,000

注1: クレジットイベント事由等には延滞債権も含まれる。延滞とは、延滞通知が提出されており参照債務残高の減額が停止しているもの。

注2: 未確定とは、クレジットイベントが確定していないもの。

注3: 参照債務残高とデフォルト認定金額との差異は、部分償還ないし預金相殺等による一部入金の結果生じたもの。

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)

デフォルト債権及び延滞債権一覧

2019/12/06現在

取扱金融機関	業種	クレジットイベント事由等(注1)	事由発生日	デフォルト金額 確定日(注2)	参照債務残高 (注3)	デフォルト認 定金額(注3)	当初元本
大阪シティ信用金庫	卸売・小売業	支払不履行	2018/8/20	2018/11/1	21,875,000	21,875,000	30,000,000
大阪シティ信用金庫	卸売・小売業	延滞	2019/5/20	未確定	7,675,000	0	16,000,000
姫路信用金庫	運輸業	延滞	2018/11/20	未確定	12,096,000	0	20,000,000
姫路信用金庫	卸売・小売業	延滞	2018/12/20	未確定	11,680,000	0	20,000,000
長野県信用組合	運輸業	延滞	2019/10/21	未確定	5,640,000	0	15,000,000
長野県信用組合	運輸業	延滞	2019/11/20	未確定	7,104,000	0	20,000,000

注1: クレジットイベント事由等には延滞債権も含まれる。延滞とは、延滞通知が提出されており参照債務残高の減額が停止しているもの。

注2: 未確定とは、クレジットイベントが確定していないもの。

注3: 参照債務残高とデフォルト認定金額との差異は、部分償還ないし預金相殺等による一部入金の結果生じたもの。