

「地域金融機関CLO シンセティック型(合同会社クローバー2021)」発行後情報開示サマリー
(令和4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	¥10,000,000,000	¥3,100,000,000
利率	0.29%	0.19%
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】 ・初回を令和3年6月21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	JCR 当初: AAA 現在: AAA	JCR 当初: AAA 現在: AAA

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)	株式会社山形銀行、株式会社七十七銀行、株式会社清水銀行、株式会社栃木銀行、北海道信用金庫、旭川信用金庫、城南信用金庫、多摩信用金庫、高山信用金庫、大阪信用金庫、姫路信用金庫、高松信用金庫、熊本信用金庫、新潟縣信用組合(合計14金融機関、金融機関コード順)
財務代理人	三井住友信託銀行株式会社
独立認定人	株式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26.2%)の設定 流動性補完: プレミアムの3ヵ月前取分、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) ¥3,303,000,000(注1) C号社債(合計) ¥3,100,000,000(注1)(注2) 免責金額(合計) ¥601,000,000(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) ¥8,713,000(注4) 免責金額(合計) ¥34,000,000(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(令和3年3月)	令和4年12月6日時点
参照債務残高	¥17,004,000,000	¥9,837,321,000(注5)
参照債務残高率	100.00%	57.85%
クレジットイベント発生率(注1)	0.00%	0.00%
累積クレジットイベント発生率(注2)	0.00%	0.25%
期限前弁済発生率(注3)	0.00%	2.06%
累積期限前弁済発生率(注4)	0.00%	3.80%
参照債務件数	801件	733件
一参照債務あたり平均貸出残高	¥21,228,464	¥13,420,628

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、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)期限前弁済発生率(%) : 期中期限前弁済金額/期初参照債務残高
(注4)累積期限前弁済発生率(%) : 累積期限前弁済金額/当初参照債務残高
(注5)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2021)」発行後情報開示サマリー
(令和4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)		期限前弁済金額(注1)		(ご参考)
	当初 (3年3月)	現在 (4年12月6日)	4.9.6～4.12.6	累積	4.9.6～4.12.6	累積	免責金額
山形銀行	¥475,000,000	¥275,327,000	¥0	¥0	¥0	¥43,754,000	¥32,000,000
七十七銀行	¥508,000,000	¥283,809,000	¥0	¥42,713,000	¥0	¥0	¥34,000,000
清水銀行	¥3,461,000,000	¥2,048,993,000	¥0	¥0	¥0	¥80,849,000	¥155,000,000
栃木銀行	¥2,663,000,000	¥1,366,629,000	¥0	¥0	¥128,481,000	¥315,929,000	¥60,000,000
北海道信用金庫	¥394,000,000	¥235,100,000	¥0	¥0	¥0	¥4,376,000	¥23,000,000
旭川信用金庫	¥225,000,000	¥136,080,000	¥0	¥0	¥0	¥0	¥13,000,000
城南信用金庫	¥5,160,000,000	¥3,078,750,000	¥0	¥0	¥39,375,000	¥91,250,000	¥120,000,000
多摩信用金庫	¥270,000,000	¥168,750,000	¥0	¥0	¥0	¥0	¥20,000,000
高山信用金庫	¥42,000,000	¥19,346,000	¥0	¥0	¥3,232,000	¥7,712,000	¥11,000,000
大阪信用金庫	¥1,112,000,000	¥673,535,000	¥0	¥0	¥0	¥6,174,000	¥44,000,000
姫路信用金庫	¥640,000,000	¥350,992,000	¥0	¥0	¥37,536,000	¥37,536,000	¥22,000,000
高松信用金庫	¥1,370,000,000	¥787,859,000	¥0	¥0	¥15,640,000	¥54,969,000	¥34,000,000
熊本信用金庫	¥439,000,000	¥263,956,000	¥0	¥0	¥3,024,000	¥3,024,000	¥18,000,000
新潟縣信用組合	¥245,000,000	¥148,195,000	¥0	¥0	¥0	¥0	¥15,000,000
合計	¥17,004,000,000	¥9,837,321,000	¥0	¥42,713,000	¥227,288,000	¥645,573,000	¥601,000,000

(注1) 掲示している期間内に確定している金額

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
2021/3/16 ～ 2021/6/21	17,004,000,000	363,821,000	16,640,179,000	0	0	601,000,000	0
2021/6/22 ～ 2021/9/21	16,640,179,000	1,060,068,000	15,580,111,000	0	0	601,000,000	0
2021/9/22 ～ 2021/12/20	15,580,111,000	1,301,388,000	14,278,723,000	0	0	601,000,000	0
2021/12/21 ～ 2022/3/22	14,278,723,000	1,134,481,000	13,144,242,000	0	0	601,000,000	0
2022/3/23 ～ 2022/6/20	13,144,242,000	1,067,683,000	12,076,559,000	42,713,000	42,713,000	601,000,000	8,713,000
2022/6/21 ～ 2022/9/20	12,076,559,000	1,032,409,000	11,044,150,000	0	42,713,000	601,000,000	8,713,000
2022/9/21 ～ 2022/12/20	11,044,150,000	1,206,829,000	9,837,321,000	0	42,713,000	601,000,000	8,713,000
2022/12/21 ～ 2023/3/20	9,837,321,000			0	42,713,000	601,000,000	0
2023/3/21 ～ 2023/6/20				0	42,713,000	601,000,000	0
2023/6/21 ～ 2023/9/20				0	42,713,000	601,000,000	0
2023/9/21 ～ 2023/12/20				0	42,713,000	601,000,000	0
2023/12/21 ～ 2024/3/21				0	42,713,000	601,000,000	0
2024/3/22 ～ 2024/6/20				0	42,713,000	601,000,000	0
2024/6/21 ～ 2024/9/20				0	42,713,000	601,000,000	0
2024/9/21 ～ 2024/12/20				0	42,713,000	601,000,000	0
2024/12/21 ～ 2025/5/30				0	42,713,000	601,000,000	0

山形銀行

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
2021/3/16 ～ 2021/6/21	475,000,000	9,888,000	465,112,000	0	0	32,000,000	0
2021/6/22 ～ 2021/9/21	465,112,000	29,664,000	435,448,000	0	0	32,000,000	0
2021/9/22 ～ 2021/12/20	435,448,000	71,129,000	364,319,000	0	0	32,000,000	0
2021/12/21 ～ 2022/3/22	364,319,000	23,418,000	340,901,000	0	0	32,000,000	0
2022/3/23 ～ 2022/6/20	340,901,000	21,858,000	319,043,000	0	0	32,000,000	0
2022/6/21 ～ 2022/9/20	319,043,000	21,858,000	297,185,000	0	0	32,000,000	0
2022/9/21 ～ 2022/12/20	297,185,000	21,858,000	275,327,000	0	0	32,000,000	0
2022/12/21 ～ 2023/3/20	275,327,000					32,000,000	
2023/3/21 ～ 2023/6/20						32,000,000	
2023/6/21 ～ 2023/9/20						32,000,000	
2023/9/21 ～ 2023/12/20						32,000,000	
2023/12/21 ～ 2024/3/21						32,000,000	
2024/3/22 ～ 2024/6/20						32,000,000	
2024/6/21 ～ 2024/9/20						32,000,000	
2024/9/21 ～ 2024/12/20						32,000,000	
2024/12/21 ～ 2025/5/30						32,000,000	

「地域金融機関CLO シンセティック型(合同会社クローバー2021)」発行後情報開示サマリー

(令和4年12月6日時点)

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
2021/3/16 ~ 2021/6/21	508,000,000	10,576,000	497,424,000	0	0	34,000,000	0
2021/6/22 ~ 2021/9/21	497,424,000	31,728,000	465,696,000	0	0	34,000,000	0
2021/9/22 ~ 2021/12/20	465,696,000	31,728,000	433,968,000	0	0	34,000,000	0
2021/12/21 ~ 2022/3/22	433,968,000	28,605,000	405,363,000	0	0	34,000,000	0
2022/3/23 ~ 2022/6/20	405,363,000	71,214,000	334,149,000	42,713,000	42,713,000	34,000,000	8,713,000
2022/6/21 ~ 2022/9/20	334,149,000	25,170,000	308,979,000	0	42,713,000	34,000,000	8,713,000
2022/9/21 ~ 2022/12/20	308,979,000	25,170,000	283,809,000	0	42,713,000	34,000,000	8,713,000
2022/12/21 ~ 2023/3/20	283,809,000					34,000,000	
2023/3/21 ~ 2023/6/20						34,000,000	
2023/6/21 ~ 2023/9/20						34,000,000	
2023/9/21 ~ 2023/12/20						34,000,000	
2023/12/21 ~ 2024/3/21						34,000,000	
2024/3/22 ~ 2024/6/20						34,000,000	
2024/6/21 ~ 2024/9/20						34,000,000	
2024/9/21 ~ 2024/12/20						34,000,000	
2024/12/21 ~ 2025/5/30						34,000,000	

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
2021/3/16 ~ 2021/6/21	3,461,000,000	72,049,000	3,388,951,000	0	0	155,000,000	0
2021/6/22 ~ 2021/9/21	3,388,951,000	216,147,000	3,172,804,000	0	0	155,000,000	0
2021/9/22 ~ 2021/12/20	3,172,804,000	275,948,000	2,896,856,000	0	0	155,000,000	0
2021/12/21 ~ 2022/3/22	2,896,856,000	230,328,000	2,666,528,000	0	0	155,000,000	0
2022/3/23 ~ 2022/6/20	2,666,528,000	205,845,000	2,460,683,000	0	0	155,000,000	0
2022/6/21 ~ 2022/9/20	2,460,683,000	205,845,000	2,254,838,000	0	0	155,000,000	0
2022/9/21 ~ 2022/12/20	2,254,838,000	205,845,000	2,048,993,000	0	0	155,000,000	0
2022/12/21 ~ 2023/3/20	2,048,993,000					155,000,000	
2023/3/21 ~ 2023/6/20						155,000,000	
2023/6/21 ~ 2023/9/20						155,000,000	
2023/9/21 ~ 2023/12/20						155,000,000	
2023/12/21 ~ 2024/3/21						155,000,000	
2024/3/22 ~ 2024/6/20						155,000,000	
2024/6/21 ~ 2024/9/20						155,000,000	
2024/9/21 ~ 2024/12/20						155,000,000	
2024/12/21 ~ 2025/5/30						155,000,000	

栃木銀行

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
2021/3/16 ~ 2021/6/21	2,663,000,000	55,429,000	2,607,571,000	0	0	60,000,000	0
2021/6/22 ~ 2021/9/21	2,607,571,000	166,287,000	2,441,284,000	0	0	60,000,000	0
2021/9/22 ~ 2021/12/20	2,441,284,000	273,087,000	2,168,197,000	0	0	60,000,000	0
2021/12/21 ~ 2022/3/22	2,168,197,000	210,462,000	1,957,735,000	0	0	60,000,000	0
2022/3/23 ~ 2022/6/20	1,957,735,000	151,117,000	1,806,618,000	0	0	60,000,000	0
2022/6/21 ~ 2022/9/20	1,806,618,000	170,508,000	1,636,110,000	0	0	60,000,000	0
2022/9/21 ~ 2022/12/20	1,636,110,000	269,481,000	1,366,629,000	0	0	60,000,000	0
2022/12/21 ~ 2023/3/20	1,366,629,000					60,000,000	
2023/3/21 ~ 2023/6/20						60,000,000	
2023/6/21 ~ 2023/9/20						60,000,000	
2023/9/21 ~ 2023/12/20						60,000,000	
2023/12/21 ~ 2024/3/21						60,000,000	
2024/3/22 ~ 2024/6/20						60,000,000	
2024/6/21 ~ 2024/9/20						60,000,000	
2024/9/21 ~ 2024/12/20						60,000,000	
2024/12/21 ~ 2025/5/30						60,000,000	

北海道信用金庫

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
2021/3/16 ~ 2021/6/21	394,000,000	8,204,000	385,796,000	0	0	23,000,000	0
2021/6/22 ~ 2021/9/21	385,796,000	24,612,000	361,184,000	0	0	23,000,000	0
2021/9/22 ~ 2021/12/20	361,184,000	28,884,000	332,300,000	0	0	23,000,000	0
2021/12/21 ~ 2022/3/22	332,300,000	24,300,000	308,000,000	0	0	23,000,000	0
2022/3/23 ~ 2022/6/20	308,000,000	24,300,000	283,700,000	0	0	23,000,000	0
2022/6/21 ~ 2022/9/20	283,700,000	24,300,000	259,400,000	0	0	23,000,000	0
2022/9/21 ~ 2022/12/20	259,400,000	24,300,000	235,100,000	0	0	23,000,000	0
2022/12/21 ~ 2023/3/20	235,100,000					23,000,000	
2023/3/21 ~ 2023/6/20						23,000,000	
2023/6/21 ~ 2023/9/20						23,000,000	
2023/9/21 ~ 2023/12/20						23,000,000	
2023/12/21 ~ 2024/3/21						23,000,000	
2024/3/22 ~ 2024/6/20						23,000,000	
2024/6/21 ~ 2024/9/20						23,000,000	
2024/9/21 ~ 2024/12/20						23,000,000	
2024/12/21 ~ 2025/5/30						23,000,000	

「地域金融機関CLO シンセティック型(合同会社クローバー2021)」発行後情報開示サマリー

(令和4年12月6日時点)

旭川信用金庫

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
2021/3/16	～ 2021/6/21	225,000,000	4,680,000	220,320,000	0	0	13,000,000	0
2021/6/22	～ 2021/9/21	220,320,000	14,040,000	206,280,000	0	0	13,000,000	0
2021/9/22	～ 2021/12/20	206,280,000	14,040,000	192,240,000	0	0	13,000,000	0
2021/12/21	～ 2022/3/22	192,240,000	14,040,000	178,200,000	0	0	13,000,000	0
2022/3/23	～ 2022/6/20	178,200,000	14,040,000	164,160,000	0	0	13,000,000	0
2022/6/21	～ 2022/9/20	164,160,000	14,040,000	150,120,000	0	0	13,000,000	0
2022/9/21	～ 2022/12/20	150,120,000	14,040,000	136,080,000	0	0	13,000,000	0
2022/12/21	～ 2023/3/20	136,080,000					13,000,000	
2023/3/21	～ 2023/6/20						13,000,000	
2023/6/21	～ 2023/9/20						13,000,000	
2023/9/21	～ 2023/12/20						13,000,000	
2023/12/21	～ 2024/3/21						13,000,000	
2024/3/22	～ 2024/6/20						13,000,000	
2024/6/21	～ 2024/9/20						13,000,000	
2024/9/21	～ 2024/12/20						13,000,000	
2024/12/21	～ 2025/5/30						13,000,000	

城南信用金庫

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
2021/3/16	～ 2021/6/21	5,160,000,000	107,500,000	5,052,500,000	0	0	120,000,000	0
2021/6/22	～ 2021/9/21	5,052,500,000	321,250,000	4,731,250,000	0	0	120,000,000	0
2021/9/22	～ 2021/12/20	4,731,250,000	346,250,000	4,385,000,000	0	0	120,000,000	0
2021/12/21	～ 2022/3/22	4,385,000,000	341,250,000	4,043,750,000	0	0	120,000,000	0
2022/3/23	～ 2022/6/20	4,043,750,000	312,500,000	3,731,250,000	0	0	120,000,000	0
2022/6/21	～ 2022/9/20	3,731,250,000	308,750,000	3,422,500,000	0	0	120,000,000	0
2022/9/21	～ 2022/12/20	3,422,500,000	343,750,000	3,078,750,000	0	0	120,000,000	0
2022/12/21	～ 2023/3/20	3,078,750,000					120,000,000	
2023/3/21	～ 2023/6/20						120,000,000	
2023/6/21	～ 2023/9/20						120,000,000	
2023/9/21	～ 2023/12/20						120,000,000	
2023/12/21	～ 2024/3/21						120,000,000	
2024/3/22	～ 2024/6/20						120,000,000	
2024/6/21	～ 2024/9/20						120,000,000	
2024/9/21	～ 2024/12/20						120,000,000	
2024/12/21	～ 2025/5/30						120,000,000	

多摩信用金庫

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
2021/3/16	～ 2021/6/21	270,000,000	5,625,000	264,375,000	0	0	20,000,000	0
2021/6/22	～ 2021/9/21	264,375,000	16,875,000	247,500,000	0	0	20,000,000	0
2021/9/22	～ 2021/12/20	247,500,000	16,875,000	230,625,000	0	0	20,000,000	0
2021/12/21	～ 2022/3/22	230,625,000	16,875,000	213,750,000	0	0	20,000,000	0
2022/3/23	～ 2022/6/20	213,750,000	15,000,000	198,750,000	0	0	20,000,000	0
2022/6/21	～ 2022/9/20	198,750,000	15,000,000	183,750,000	0	0	20,000,000	0
2022/9/21	～ 2022/12/20	183,750,000	15,000,000	168,750,000	0	0	20,000,000	0
2022/12/21	～ 2023/3/20	168,750,000					20,000,000	
2023/3/21	～ 2023/6/20						20,000,000	
2023/6/21	～ 2023/9/20						20,000,000	
2023/9/21	～ 2023/12/20						20,000,000	
2023/12/21	～ 2024/3/21						20,000,000	
2024/3/22	～ 2024/6/20						20,000,000	
2024/6/21	～ 2024/9/20						20,000,000	
2024/9/21	～ 2024/12/20						20,000,000	
2024/12/21	～ 2025/5/30						20,000,000	

高山信用金庫

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
2021/3/16	～ 2021/6/21	42,000,000	874,000	41,126,000	0	0	11,000,000	0
2021/6/22	～ 2021/9/21	41,126,000	2,622,000	38,504,000	0	0	11,000,000	0
2021/9/22	～ 2021/12/20	38,504,000	6,894,000	31,610,000	0	0	11,000,000	0
2021/12/21	～ 2022/3/22	31,610,000	2,310,000	29,300,000	0	0	11,000,000	0
2022/3/23	～ 2022/6/20	29,300,000	2,310,000	26,990,000	0	0	11,000,000	0
2022/6/21	～ 2022/9/20	26,990,000	2,310,000	24,680,000	0	0	11,000,000	0
2022/9/21	～ 2022/12/20	24,680,000	5,334,000	19,346,000	0	0	11,000,000	0
2022/12/21	～ 2023/3/20	19,346,000					11,000,000	
2023/3/21	～ 2023/6/20						11,000,000	
2023/6/21	～ 2023/9/20						11,000,000	
2023/9/21	～ 2023/12/20						11,000,000	
2023/12/21	～ 2024/3/21						11,000,000	
2024/3/22	～ 2024/6/20						11,000,000	
2024/6/21	～ 2024/9/20						11,000,000	
2024/9/21	～ 2024/12/20						11,000,000	
2024/12/21	～ 2025/5/30						11,000,000	

「地域金融機関CLO シンセティック型(合同会社クローバー2021)」発行後情報開示サマリー

(令和4年12月6日時点)

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
2021/3/16 ~ 2021/6/21	1,112,000,000	23,151,000	1,088,849,000	0	0	44,000,000	0
2021/6/22 ~ 2021/9/21	1,088,849,000	69,453,000	1,019,396,000	0	0	44,000,000	0
2021/9/22 ~ 2021/12/20	1,019,396,000	69,453,000	949,943,000	0	0	44,000,000	0
2021/12/21 ~ 2022/3/22	949,943,000	75,793,000	874,150,000	0	0	44,000,000	0
2022/3/23 ~ 2022/6/20	874,150,000	68,330,000	805,820,000	0	0	44,000,000	0
2022/6/21 ~ 2022/9/20	805,820,000	67,080,000	738,740,000	0	0	44,000,000	0
2022/9/21 ~ 2022/12/20	738,740,000	65,205,000	673,535,000	0	0	44,000,000	0
2022/12/21 ~ 2023/3/20	673,535,000					44,000,000	
2023/3/21 ~ 2023/6/20						44,000,000	
2023/6/21 ~ 2023/9/20						44,000,000	
2023/9/21 ~ 2023/12/20						44,000,000	
2023/12/21 ~ 2024/3/21						44,000,000	
2024/3/22 ~ 2024/6/20						44,000,000	
2024/6/21 ~ 2024/9/20						44,000,000	
2024/9/21 ~ 2024/12/20						44,000,000	
2024/12/21 ~ 2025/5/30						44,000,000	

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
2021/3/16 ~ 2021/6/21	640,000,000	13,312,000	626,688,000	0	0	22,000,000	0
2021/6/22 ~ 2021/9/21	626,688,000	39,936,000	586,752,000	0	0	22,000,000	0
2021/9/22 ~ 2021/12/20	586,752,000	39,936,000	546,816,000	0	0	22,000,000	0
2021/12/21 ~ 2022/3/22	546,816,000	39,936,000	506,880,000	0	0	22,000,000	0
2022/3/23 ~ 2022/6/20	506,880,000	39,936,000	466,944,000	0	0	22,000,000	0
2022/6/21 ~ 2022/9/20	466,944,000	39,936,000	427,008,000	0	0	22,000,000	0
2022/9/21 ~ 2022/12/20	427,008,000	76,016,000	350,992,000	0	0	22,000,000	0
2022/12/21 ~ 2023/3/20	350,992,000					22,000,000	
2023/3/21 ~ 2023/6/20						22,000,000	
2023/6/21 ~ 2023/9/20						22,000,000	
2023/9/21 ~ 2023/12/20						22,000,000	
2023/12/21 ~ 2024/3/21						22,000,000	
2024/3/22 ~ 2024/6/20						22,000,000	
2024/6/21 ~ 2024/9/20						22,000,000	
2024/9/21 ~ 2024/12/20						22,000,000	
2024/12/21 ~ 2025/5/30						22,000,000	

高松信用金庫

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
2021/3/16 ~ 2021/6/21	1,370,000,000	38,308,000	1,331,692,000	0	0	34,000,000	0
2021/6/22 ~ 2021/9/21	1,331,692,000	84,924,000	1,246,768,000	0	0	34,000,000	0
2021/9/22 ~ 2021/12/20	1,246,768,000	84,924,000	1,161,844,000	0	0	34,000,000	0
2021/12/21 ~ 2022/3/22	1,161,844,000	84,924,000	1,076,920,000	0	0	34,000,000	0
2022/3/23 ~ 2022/6/20	1,076,920,000	98,993,000	977,927,000	0	0	34,000,000	0
2022/6/21 ~ 2022/9/20	977,927,000	95,082,000	882,845,000	0	0	34,000,000	0
2022/9/21 ~ 2022/12/20	882,845,000	94,986,000	787,859,000	0	0	34,000,000	0
2022/12/21 ~ 2023/3/20	787,859,000					34,000,000	
2023/3/21 ~ 2023/6/20						34,000,000	
2023/6/21 ~ 2023/9/20						34,000,000	
2023/9/21 ~ 2023/12/20						34,000,000	
2023/12/21 ~ 2024/3/21						34,000,000	
2024/3/22 ~ 2024/6/20						34,000,000	
2024/6/21 ~ 2024/9/20						34,000,000	
2024/9/21 ~ 2024/12/20						34,000,000	
2024/12/21 ~ 2025/5/30						34,000,000	

熊本信用金庫

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
2021/3/16 ~ 2021/6/21	439,000,000	9,130,000	429,870,000	0	0	18,000,000	0
2021/6/22 ~ 2021/9/21	429,870,000	27,245,000	402,625,000	0	0	18,000,000	0
2021/9/22 ~ 2021/12/20	402,625,000	26,955,000	375,670,000	0	0	18,000,000	0
2021/12/21 ~ 2022/3/22	375,670,000	26,955,000	348,715,000	0	0	18,000,000	0
2022/3/23 ~ 2022/6/20	348,715,000	26,955,000	321,760,000	0	0	18,000,000	0
2022/6/21 ~ 2022/9/20	321,760,000	27,245,000	294,515,000	0	0	18,000,000	0
2022/9/21 ~ 2022/12/20	294,515,000	30,559,000	263,956,000	0	0	18,000,000	0
2022/12/21 ~ 2023/3/20	263,956,000					18,000,000	
2023/3/21 ~ 2023/6/20						18,000,000	
2023/6/21 ~ 2023/9/20						18,000,000	
2023/9/21 ~ 2023/12/20						18,000,000	
2023/12/21 ~ 2024/3/21						18,000,000	
2024/3/22 ~ 2024/6/20						18,000,000	
2024/6/21 ~ 2024/9/20						18,000,000	
2024/9/21 ~ 2024/12/20						18,000,000	
2024/12/21 ~ 2025/5/30						18,000,000	

新潟県信用組合

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
2021/3/16 ~ 2021/6/21	245,000,000	5,095,000	239,905,000	0	0	15,000,000	0
2021/6/22 ~ 2021/9/21	239,905,000	15,285,000	224,620,000	0	0	15,000,000	0
2021/9/22 ~ 2021/12/20	224,620,000	15,285,000	209,335,000	0	0	15,000,000	0
2021/12/21 ~ 2022/3/22	209,335,000	15,285,000	194,050,000	0	0	15,000,000	0
2022/3/23 ~ 2022/6/20	194,050,000	15,285,000	178,765,000	0	0	15,000,000	0
2022/6/21 ~ 2022/9/20	178,765,000	15,285,000	163,480,000	0	0	15,000,000	0
2022/9/21 ~ 2022/12/20	163,480,000	15,285,000	148,195,000	0	0	15,000,000	0
2022/12/21 ~ 2023/3/20	148,195,000					15,000,000	
2023/3/21 ~ 2023/6/20						15,000,000	
2023/6/21 ~ 2023/9/20						15,000,000	
2023/9/21 ~ 2023/12/20						15,000,000	
2023/12/21 ~ 2024/3/21						15,000,000	
2024/3/22 ~ 2024/6/20						15,000,000	
2024/6/21 ~ 2024/9/20						15,000,000	
2024/9/21 ~ 2024/12/20						15,000,000	
2024/12/21 ~ 2025/5/30						15,000,000	

※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2021)

業種別デフォルト分布

2022/12/06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	0	0.0%	0	0.0%
製造業	0	0.0%	0	0.0%
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	50	100.0%	1	100.0%
不動産業	0	0.0%	0	0.0%
飲食店、宿泊業	0	0.0%	0	0.0%
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	50	100%	1	100%

	1				2				3				4				5			
	株式会社 山形銀行				株式会社 七十七銀行				株式会社 清水銀行				株式会社 栃木銀行				北海道信用金庫			
	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%	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%	50	100.0%	1	100.0%	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	0	0.0%	0	0.0%	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%	0	0%	0	0%	0	0%	0	0%	0	0%	0	0%

	6				7				8				9				10			
	旭川信用金庫				城南信用金庫				多摩信用金庫				高山信用金庫				大阪信用金庫			
	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%	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%	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	0	0.0%	0	0.0%	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%	0	0%	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2021)

業種別デフォルト分布

2022/12/06現在

	11				12				13				14 (単位:百万円)			
	姫路信用金庫				高松信用金庫				熊本信用金庫				新潟県信用組合			
	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	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%
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%
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%
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%
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%
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%
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%
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%
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%
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%
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%
総計	0	0%	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2021)

貸付金額別デフォルト分布

2022/12/06現在

(単位:百万円)

		合計			
		金額	比率	件数	比率
10百万円以下		0	0.0%	0	0.0%
10百万円超 20百万円以下		0	0.0%	0	0.0%
20百万円超 30百万円以下		0	0.0%	0	0.0%
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		50	100.0%	1	100.0%
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		50	100%	1	100%

		1				2				3				4				5			
		株式会社 山形銀行				株式会社 七十七銀行				株式会社 清水銀行				株式会社 栃木銀行				北海道信用金庫			
		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%	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		0	0.0%	0	0.0%	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		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%	0	0%	0	0%	0	0%	0	0%	0	0%	0	0%

		6				7				8				9				10			
		旭川信用金庫				城南信用金庫				多摩信用金庫				高山信用金庫				大阪信用金庫			
		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%	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		0	0.0%	0	0.0%	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		0	0.0%	0	0.0%	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%	0	0%	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2021)

貸付金額別デフォルト分布

2022/12/06現在

		11				12				13				14				(単位:百万円)	
		姫路信用金庫				高松信用金庫				熊本信用金庫				新潟県信用組合					
		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	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%		
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%		
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%	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%		
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%	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%		
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%		
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%		
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%		
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%		
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%		
総計		0	0%	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2021)

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)

2022/12/06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	0	0.0%	0	0.0%
0.4%超	0.5%以下	50	100.0%	1	100.0%
0.5%超	0.6%以下	0	0.0%	0	0.0%
0.6%超	0.7%以下	0	0.0%	0	0.0%
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		50	100%	1	100%

		1 株式会社 山形銀行				2 株式会社 七十七銀行				3 株式会社 清水銀行				4 株式会社 栃木銀行				5 北海道信用金庫			
		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%	50	100.0%	1	100.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
0.5%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%	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%	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2021)

CRDモデル3 累積1年デフォルト確率別デフォルト分布

2022/12/06現在

		6				7				8				9				10 (単位:百万円)			
		旭川信用金庫				城南信用金庫				多摩信用金庫				高山信用金庫				大阪信用金庫			
		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%	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%	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%	0	0%	0	0%	0	0%	0	0%	0	0%	0	0%	0	0%	0	0%

		11				12				13				14 (単位:百万円)			
		姫路信用金庫				高松信用金庫				熊本信用金庫				新潟県信用組合			
		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	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%
0.1%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%
0.2%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%
0.3%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%
0.4%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%
0.5%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%
0.6%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%
0.7%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%
0.8%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%
0.9%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%
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%
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%
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%
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%
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%
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%
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%
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%
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%
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%
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%
総計		0	0%	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2021)

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)

2022/12/06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	0	0.0%	0	0.0%
0.4%超	0.5%以下	0	0.0%	0	0.0%
0.5%超	0.6%以下	0	0.0%	0	0.0%
0.6%超	0.7%以下	0	0.0%	0	0.0%
0.7%超	0.8%以下	0	0.0%	0	0.0%
0.8%超	0.9%以下	50	100.0%	1	100.0%
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		50	100%	1	100%

		1				2				3				4				5			
		株式会社 山形銀行				株式会社 七十七銀行				株式会社 清水銀行				株式会社 栃木銀行				北海道信用金庫			
		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%	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%	0	0.0%	0	0.0%
0.8%超	0.9%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%
0.9%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%	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(合同会社クロバー2021)

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

2022/12/06現在

(単位:百万円)

		6 旭川信用金庫				7 城南信用金庫				8 多摩信用金庫				9 高山信用金庫				10 大阪信用金庫			
		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%	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%	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%	0	0%	0	0%	0	0%	0	0%	0	0%	0	0%	0	0%	0	0%

		11 姫路信用金庫				12 高松信用金庫				13 熊本信用金庫				14 新潟県信用組合			
		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	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%
0.1%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%
0.2%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%
0.3%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%
0.4%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%
0.5%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%
0.6%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%
0.7%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%
0.8%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%
0.9%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%
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%
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%
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%
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%
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%
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%
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%
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%
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%
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%
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%
総計		0	0%	0	0%	0	0%	0	0%	0	0%	0	0%	0	0%	0	0%

(単位:百万円)

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2021)

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)

2022/12/06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	0	0.0%	0	0.0%
0.4%超	0.5%以下	0	0.0%	0	0.0%
0.5%超	0.6%以下	0	0.0%	0	0.0%
0.6%超	0.7%以下	0	0.0%	0	0.0%
0.7%超	0.8%以下	0	0.0%	0	0.0%
0.8%超	0.9%以下	50	100.0%	1	100.0%
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		50	100%	1	100%

		1				2				3				4				5			
		株式会社 山形銀行				株式会社 七十七銀行				株式会社 清水銀行				株式会社 栃木銀行				北海道信用金庫			
		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%	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%	0	0.0%	0	0.0%
0.8%超	0.9%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%
0.9%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%	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2021)

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

2022/12/06現在

(単位:百万円)

		6 旭川信用金庫				7 城南信用金庫				8 多摩信用金庫				9 高山信用金庫				10 大阪信用金庫			
		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%	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%	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%	0	0%	0	0%	0	0%	0	0%	0	0%	0	0%	0	0%	0	0%

		11 姫路信用金庫				12 高松信用金庫				13 熊本信用金庫				14 新潟県信用組合			
		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	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%
0.1%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%
0.2%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%
0.3%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%
0.4%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%
0.5%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%
0.6%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%
0.7%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%
0.8%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%
0.9%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%
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%
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%
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%
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%
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%
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%
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%
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%
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%
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%
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%
総計		0	0%	0	0%	0	0%	0	0%	0	0%	0	0%	0	0%	0	0%

(単位:百万円)

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2021)

CRITSデフォルト確率別デフォルト分布

2022/12/06現在

(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		0	0.0%	0	0.0%
0.5%超 0.6%以下		0	0.0%	0	0.0%
0.6%超 0.7%以下		0	0.0%	0	0.0%
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		50	100.0%	1	100.0%
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		50	100%	1	100%

(単位:百万円)

		1 株式会社 山形銀行				2 株式会社 七十七銀行				3 株式会社 清水銀行				4 株式会社 栃木銀行				5 北海道信用金庫			
		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%	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%	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%	50	100.0%	1	100.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
1.7%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%	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2021)

CRITSデフォルト確率別デフォルト分布

2022/12/06現在

(単位:百万円)

		6 旭川信用金庫				7 城南信用金庫				8 多摩信用金庫				9 高山信用金庫				10 大阪信用金庫			
		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%	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%	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%	0	0%	0	0%	0	0%	0	0%	0	0%	0	0%	0	0%	0	0%

		11 姫路信用金庫				12 高松信用金庫				13 熊本信用金庫				14 新潟県信用組合			
		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	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%
0.1%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%
0.2%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%
0.3%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%
0.4%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%
0.5%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%
0.6%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%
0.7%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%
0.8%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%
0.9%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%
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%
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%
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%
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%
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%
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%
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%
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%
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%
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%
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%
総計		0	0%	0	0%	0	0%	0	0%	0	0%	0	0%	0	0%	0	0%

(単位:百万円)

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2021)

デフォルト債権及び延滞債権一覧

2022/12/06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 山形銀行	卸売・小売業	延滞	2021/8/20	未確定	18,336,000	0	20,000,000
株式会社 山形銀行	運輸業	延滞	2021/11/22	未確定	25,625,000	0	30,000,000
株式会社 山形銀行	サービス業(他に分類 されないもの)	延滞	2022/2/21	未確定	19,800,000	0	25,000,000
株式会社 七十七銀行	卸売・小売業	法的破綻等(破産手続開始)	2022/3/7	2022/4/20	42,713,000	42,713,000	50,000,000
株式会社 七十七銀行	サービス業(他に分類 されないもの)	延滞	2022/4/20	未確定	3,752,000	0	5,000,000
株式会社 七十七銀行	建設業	延滞	2022/5/20	未確定	36,467,000	0	50,000,000
株式会社 清水銀行	飲食店、宿泊業	延滞	2021/11/22	未確定	17,088,000	0	20,000,000
株式会社 清水銀行	飲食店、宿泊業	延滞	2022/2/21	未確定	39,590,000	0	50,000,000
株式会社 栃木銀行	製造業	延滞	2021/11/22	未確定	25,625,000	0	30,000,000
株式会社 栃木銀行	情報通信業	延滞	2022/3/22	未確定	23,125,000	0	30,000,000
株式会社 栃木銀行	建設業	延滞	2022/8/22	未確定	3,336,000	0	5,000,000
株式会社 栃木銀行	運輸業	延滞	2022/8/22	未確定	3,336,000	0	5,000,000
城南信用金庫	サービス業(他に分類 されないもの)	延滞	2021/6/21	未確定	28,750,000	0	30,000,000
城南信用金庫	運輸業	延滞	2021/12/20	未確定	25,000,000	0	30,000,000
城南信用金庫	卸売・小売業	延滞	2022/3/22	未確定	23,125,000	0	30,000,000
城南信用金庫	卸売・小売業	延滞	2022/4/20	未確定	22,500,000	0	30,000,000
城南信用金庫	情報通信業	延滞	2022/4/20	未確定	22,500,000	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2021)

デフォルト債権及び延滞債権一覧

2022/12/06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
城南信用金庫	建設業	延滞	2022/7/20	未確定	20,625,000	0	30,000,000
多摩信用金庫	情報通信業	延滞	2022/2/21	未確定	23,750,000	0	30,000,000
大阪信用金庫	運輸業	延滞	2022/4/20	未確定	22,500,000	0	30,000,000
大阪信用金庫	運輸業	延滞	2022/8/22	未確定	20,000,000	0	30,000,000
姫路信用金庫	運輸業	延滞	2022/9/20	未確定	3,232,000	0	5,000,000
高松信用金庫	運輸業	延滞	2022/3/22	未確定	23,125,000	0	30,000,000
高松信用金庫	運輸業	延滞	2022/9/20	未確定	9,696,000	0	15,000,000
熊本信用金庫	不動産業	延滞	2022/1/20	未確定	5,695,000	0	7,000,000

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。