

【レーティング・モニター(格下げ方向)】

地域金融機関平成18年9月CLO

信託受益権 優先受益権
メザニン受益権

地域金融機関平成19年6月CLO

信託受益権 優先受益権
メザニン受益権

格付投資情報センター(R&I)は上記の格付けをレーティング・モニターに指定しました。

【レーティング・モニター指定の理由】

地域金融機関平成18年9月CLO案件、および地域金融機関平成19年6月CLO案件は、2008年に入ってデフォルトが多く発生、裏付けプールからのデフォルト発生率がR&Iの標準シナリオと乖離してきたため、格下げ方向でレーティング・モニターに指定した。最近の状況を見極めたうえ、新たな格付けを公表する。

【格付け対象】

名称

地域金融機関平成18年9月CLO 優先受益権
地域金融機関平成18年9月CLO メザニン受益権
地域金融機関平成19年6月CLO 優先受益権
地域金融機関平成19年6月CLO メザニン受益権

格付け

(AAA) 格下げ方向
(AA) 格下げ方向
(AAA) 格下げ方向
(AA) 格下げ方向