

「地域金融機関CLO シンセティック型(株式会社こすもす2007)」発行後情報開示サマリー
(平成20年6月6日時点)

1. 発行の概要

| 項目 | A号無担保社債 | B号無担保社債 |
|----------------------------|---|---|
| 発行証券総額 | ¥6,500,000,000 | ¥10,000,000 |
| 利率(注1) | Tibor+0.32% | Tibor+0.57% |
| 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19年12月20日とし、毎年3月、6月、9月及び12月に順次償還(平成22年9月20日を除く)(休日翌営業日) ・平均年限(クレジットイベント、延滞が発生しない場合) :1.59年 | 【当初どおり変更なし】 ・初回を平成19年12月20日とし、毎年3月、6月、9月及び12月に順次償還(平成22年9月20日を除く)(休日翌営業日) ・平均年限(クレジットイベント、延滞が発生しない場合) :1.59年 |
| 格付(維持、変更等)情報 | Moody's R&I 当初: Aaa AAA 現在: Aaa AAA | Moody's R&I 当初: A2 AAA 現在: A2 AAA |

(注1)3ヵ月Tibor。但し最終回は4ヶ月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 (バイヤー) | 岩手銀行、大分銀行※、北日本銀行、豊和銀行※、宮崎太陽銀行、福島信用金庫、千葉信用金庫、尾西信用金庫、滋賀中央信用金庫、大阪信用金庫、淡路信用金庫、大分みらい信用金庫※ (金融機関コード順、合計12金融機関、※は「平成19年度大分県CLO」参加金融機関) |
| 社債管理者 | 住友信託銀行株式会社 |
| 独立認定人 | 新日本有限責任監査法人 |
| リスクに対する手当て | |
| 信用補完・流動性補完 | 信用補完: 中小公庫が保有する劣後社債(総額4.4億円)の設定 参加金融機関毎に設定する免責金額(約3.8%~約15.1%)の設定 流動性補完: プレミアムの3ヶ月前取分 |
| 劣後部分設定額 | 劣後社債(合計) ¥440,000,000(注2) 免責金額(合計) ¥472,000,000(注3) |
| うち劣後部分毀損額 | 劣後社債(合計) ¥7,340,000(注4) 免責金額(合計) ¥126,800,265(注5) |

(注2)当初劣後社債発行額

(注3)当初免責金額(合計)

(注4)各バイヤー設定の免責金額を超過した累積ポートフォリオデフォルト金額の合計

(注5)各バイヤーCDS契約毎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デフォルト金額は含まない。)

3. 裏付資産の属性、性質

| 項目 | 債券発行時点(平成19年9月) | 平成20年6月6日時点 |
|--------------------|-----------------|----------------|
| 参照債務残高 | ¥7,422,000,000 | ¥5,852,495,000 |
| 参照債務残高率 | 100.00% | 78.85% |
| クレジットイベント発生率(注1) | 0.00% | 1.60% |
| 累積クレジットイベント発生率(注2) | 0.00% | 1.81% |
| 参照債務 | 310件 | 306件 |
| 一参照債務あたり平均貸出額 | ¥23,941,935 | ¥19,125,800 |

参照債務残高及び参照債務については、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(%)

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 (19年9月) | 現在 (20年6月6日) | 2008.3.7~ 2008.6.6 | 累積 | 免責金額 | シニア劣後 上限金額 |
| 岩手銀行 | ¥881,000,000 | ¥645,341,000 | ¥68,340,000 | ¥68,340,000 | ¥61,000,000 | |
| 大分銀行 | ¥365,000,000 | ¥294,118,000 | ¥0 | ¥0 | ¥55,000,000 | |
| 北日本銀行 | ¥587,000,000 | ¥472,949,000 | ¥0 | ¥0 | ¥39,000,000 | |
| 豊和銀行 | ¥110,000,000 | ¥88,671,000 | ¥0 | ¥0 | ¥14,000,000 | |
| 宮崎太陽銀行 | ¥417,000,000 | ¥335,982,000 | ¥0 | ¥0 | ¥28,000,000 | |
| 福島信用金庫 | ¥480,000,000 | ¥386,802,000 | ¥0 | ¥0 | ¥28,000,000 | |
| 千葉信用金庫 | ¥1,384,000,000 | ¥1,115,053,000 | ¥0 | ¥0 | ¥52,000,000 | |
| 尾西信用金庫 | ¥965,000,000 | ¥777,568,000 | ¥0 | ¥0 | ¥39,000,000 | |
| 滋賀中央信用金庫 | ¥403,000,000 | ¥325,135,000 | ¥0 | ¥0 | ¥37,000,000 | |
| 大阪信用金庫 | ¥535,000,000 | ¥407,740,000 | ¥0 | ¥29,167,000 | ¥33,000,000 | |
| 淡路信用金庫 | ¥980,000,000 | ¥749,302,000 | ¥36,633,265 | ¥36,633,265 | ¥43,000,000 | |
| 大分みらい信用金庫 | ¥315,000,000 | ¥253,834,000 | ¥0 | ¥0 | ¥43,000,000 | |
| 合計 | ¥7,422,000,000 | ¥5,852,495,000 | ¥104,973,265 | ¥134,140,265 | ¥472,000,000 | ¥912,000,000 |

(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

「地域金融機関CLO シンセティック型(株式会社こすもす2007)」発行後情報開示サマリー
 (平成20年6月6日時点)

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 |
|------------------------|-----------------|-------------|----------------|-------------|----------------------|-------------|----------------|
| 2007/9/27 ~ 2007/12/20 | 7,422,000,000 | 205,978,000 | 7,216,022,000 | 0 | 0 | 472,000,000 | 0 |
| 2007/12/21 ~ 2008/3/21 | 7,216,022,000 | 644,602,000 | 6,571,420,000 | 29,167,000 | 29,167,000 | 472,000,000 | 0 |
| 2008/3/22 ~ 2008/6/20 | 6,571,420,000 | 718,925,000 | 5,852,495,000 | 104,973,265 | 134,140,265 | 472,000,000 | 7,340,000 |
| 2008/6/21 ~ 2008/9/22 | 5,852,495,000 | | | | | 472,000,000 | |
| 2008/9/23 ~ 2008/12/22 | | | | | | 472,000,000 | |
| 2008/12/23 ~ 2009/3/23 | | | | | | 472,000,000 | |
| 2009/3/24 ~ 2009/6/22 | | | | | | 472,000,000 | |
| 2009/6/23 ~ 2009/9/24 | | | | | | 472,000,000 | |
| 2009/9/25 ~ 2009/12/21 | | | | | | 472,000,000 | |
| 2009/12/22 ~ 2010/3/23 | | | | | | 472,000,000 | |
| 2010/3/24 ~ 2010/6/21 | | | | | | 472,000,000 | |
| 2010/6/22 ~ 2010/11/1 | | | | | | 472,000,000 | |
| 2010/11/2 ~ 2011/1/4 | | | | | | 472,000,000 | |

※1:免責超過金額合計=各バイヤーの免責超過金額の合計

岩手銀行

| 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 |
|------------------------|-----------------|-------------|----------------|------------|----------------------|------------|-----------|
| 2007/9/27 ~ 2007/12/20 | 881,000,000 | 24,458,000 | 856,542,000 | 0 | 0 | 61,000,000 | 0 |
| 2007/12/21 ~ 2008/3/21 | 856,542,000 | 73,374,000 | 783,168,000 | 0 | 0 | 61,000,000 | 0 |
| 2008/3/22 ~ 2008/6/20 | 783,168,000 | 137,827,000 | 645,341,000 | 68,340,000 | 68,340,000 | 61,000,000 | 7,340,000 |
| 2008/6/21 ~ 2008/9/22 | 645,341,000 | | | | | 61,000,000 | |
| 2008/9/23 ~ 2008/12/22 | | | | | | 61,000,000 | |
| 2008/12/23 ~ 2009/3/23 | | | | | | 61,000,000 | |
| 2009/3/24 ~ 2009/6/22 | | | | | | 61,000,000 | |
| 2009/6/23 ~ 2009/9/24 | | | | | | 61,000,000 | |
| 2009/9/25 ~ 2009/12/21 | | | | | | 61,000,000 | |
| 2009/12/22 ~ 2010/3/23 | | | | | | 61,000,000 | |
| 2010/3/24 ~ 2010/6/21 | | | | | | 61,000,000 | |
| 2010/6/22 ~ 2010/11/1 | | | | | | 61,000,000 | |
| 2010/11/2 ~ 2011/1/4 | | | | | | 61,000,000 | |

大分銀行

| 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 |
|------------------------|-----------------|-------------|----------------|---------|----------------------|------------|----------|
| 2007/9/27 ~ 2007/12/20 | 365,000,000 | 10,126,000 | 354,874,000 | 0 | 0 | 55,000,000 | 0 |
| 2007/12/21 ~ 2008/3/21 | 354,874,000 | 30,378,000 | 324,496,000 | 0 | 0 | 55,000,000 | 0 |
| 2008/3/22 ~ 2008/6/20 | 324,496,000 | 30,378,000 | 294,118,000 | 0 | 0 | 55,000,000 | 0 |
| 2008/6/21 ~ 2008/9/22 | 294,118,000 | | | | | 55,000,000 | |
| 2008/9/23 ~ 2008/12/22 | | | | | | 55,000,000 | |
| 2008/12/23 ~ 2009/3/23 | | | | | | 55,000,000 | |
| 2009/3/24 ~ 2009/6/22 | | | | | | 55,000,000 | |
| 2009/6/23 ~ 2009/9/24 | | | | | | 55,000,000 | |
| 2009/9/25 ~ 2009/12/21 | | | | | | 55,000,000 | |
| 2009/12/22 ~ 2010/3/23 | | | | | | 55,000,000 | |
| 2010/3/24 ~ 2010/6/21 | | | | | | 55,000,000 | |
| 2010/6/22 ~ 2010/11/1 | | | | | | 55,000,000 | |
| 2010/11/2 ~ 2011/1/4 | | | | | | 55,000,000 | |

北日本銀行

| 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 |
|------------------------|-----------------|-------------|----------------|---------|----------------------|------------|----------|
| 2007/9/27 ~ 2007/12/20 | 587,000,000 | 16,293,000 | 570,707,000 | 0 | 0 | 39,000,000 | 0 |
| 2007/12/21 ~ 2008/3/21 | 570,707,000 | 48,879,000 | 521,828,000 | 0 | 0 | 39,000,000 | 0 |
| 2008/3/22 ~ 2008/6/20 | 521,828,000 | 48,879,000 | 472,949,000 | 0 | 0 | 39,000,000 | 0 |
| 2008/6/21 ~ 2008/9/22 | 472,949,000 | | | | | 39,000,000 | |
| 2008/9/23 ~ 2008/12/22 | | | | | | 39,000,000 | |
| 2008/12/23 ~ 2009/3/23 | | | | | | 39,000,000 | |
| 2009/3/24 ~ 2009/6/22 | | | | | | 39,000,000 | |
| 2009/6/23 ~ 2009/9/24 | | | | | | 39,000,000 | |
| 2009/9/25 ~ 2009/12/21 | | | | | | 39,000,000 | |
| 2009/12/22 ~ 2010/3/23 | | | | | | 39,000,000 | |
| 2010/3/24 ~ 2010/6/21 | | | | | | 39,000,000 | |
| 2010/6/22 ~ 2010/11/1 | | | | | | 39,000,000 | |
| 2010/11/2 ~ 2011/1/4 | | | | | | 39,000,000 | |

豊和銀行

| 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 |
|------------------------|-----------------|-------------|----------------|---------|----------------------|------------|----------|
| 2007/9/27 ~ 2007/12/20 | 110,000,000 | 3,047,000 | 106,953,000 | 0 | 0 | 14,000,000 | 0 |
| 2007/12/21 ~ 2008/3/21 | 106,953,000 | 9,141,000 | 97,812,000 | 0 | 0 | 14,000,000 | 0 |
| 2008/3/22 ~ 2008/6/20 | 97,812,000 | 9,141,000 | 88,671,000 | 0 | 0 | 14,000,000 | 0 |
| 2008/6/21 ~ 2008/9/22 | 88,671,000 | | | | | 14,000,000 | |
| 2008/9/23 ~ 2008/12/22 | | | | | | 14,000,000 | |
| 2008/12/23 ~ 2009/3/23 | | | | | | 14,000,000 | |
| 2009/3/24 ~ 2009/6/22 | | | | | | 14,000,000 | |
| 2009/6/23 ~ 2009/9/24 | | | | | | 14,000,000 | |
| 2009/9/25 ~ 2009/12/21 | | | | | | 14,000,000 | |
| 2009/12/22 ~ 2010/3/23 | | | | | | 14,000,000 | |
| 2010/3/24 ~ 2010/6/21 | | | | | | 14,000,000 | |
| 2010/6/22 ~ 2010/11/1 | | | | | | 14,000,000 | |
| 2010/11/2 ~ 2011/1/4 | | | | | | 14,000,000 | |

「地域金融機関CLO シンセティック型(株式会社こすもす2007)」発行後情報開示サマリー
(平成20年6月6日時点)

宮崎太陽銀行

| 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 | 累積ホートフォリオ デフォルト金額 | 免責金額 | 免責超過金額※2 |
|------------------------|-----------------|-------------|----------------|---------|----------------------|------------|----------|
| 2007/9/27 ~ 2007/12/20 | 417,000,000 | 11,574,000 | 405,426,000 | 0 | 0 | 28,000,000 | 0 |
| 2007/12/21 ~ 2008/3/21 | 405,426,000 | 34,722,000 | 370,704,000 | 0 | 0 | 28,000,000 | 0 |
| 2008/3/22 ~ 2008/6/20 | 370,704,000 | 34,722,000 | 335,982,000 | 0 | 0 | 28,000,000 | 0 |
| 2008/6/21 ~ 2008/9/22 | 335,982,000 | | | | | 28,000,000 | |
| 2008/9/23 ~ 2008/12/22 | | | | | | 28,000,000 | |
| 2008/12/23 ~ 2009/3/23 | | | | | | 28,000,000 | |
| 2009/3/24 ~ 2009/6/22 | | | | | | 28,000,000 | |
| 2009/6/23 ~ 2007/9/24 | | | | | | 28,000,000 | |
| 2007/9/25 ~ 2009/12/21 | | | | | | 28,000,000 | |
| 2009/12/22 ~ 2010/3/23 | | | | | | 28,000,000 | |
| 2010/3/24 ~ 2010/6/21 | | | | | | 28,000,000 | |
| 2010/6/22 ~ 2010/11/1 | | | | | | 28,000,000 | |
| 2010/11/2 ~ 2011/1/4 | | | | | | 28,000,000 | |

福島信用金庫

| 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 | 累積ホートフォリオ デフォルト金額 | 免責金額 | 免責超過金額※2 |
|------------------------|-----------------|-------------|----------------|---------|----------------------|------------|----------|
| 2007/9/27 ~ 2007/12/20 | 480,000,000 | 13,314,000 | 466,686,000 | 0 | 0 | 28,000,000 | 0 |
| 2007/12/21 ~ 2008/3/21 | 466,686,000 | 39,942,000 | 426,744,000 | 0 | 0 | 28,000,000 | 0 |
| 2008/3/22 ~ 2008/6/20 | 426,744,000 | 39,942,000 | 386,802,000 | 0 | 0 | 28,000,000 | 0 |
| 2008/6/21 ~ 2008/9/22 | 386,802,000 | | | | | 28,000,000 | |
| 2008/9/23 ~ 2008/12/22 | | | | | | 28,000,000 | |
| 2008/12/23 ~ 2009/3/23 | | | | | | 28,000,000 | |
| 2009/3/24 ~ 2009/6/22 | | | | | | 28,000,000 | |
| 2009/6/23 ~ 2007/9/24 | | | | | | 28,000,000 | |
| 2007/9/25 ~ 2009/12/21 | | | | | | 28,000,000 | |
| 2009/12/22 ~ 2010/3/23 | | | | | | 28,000,000 | |
| 2010/3/24 ~ 2010/6/21 | | | | | | 28,000,000 | |
| 2010/6/22 ~ 2010/11/1 | | | | | | 28,000,000 | |
| 2010/11/2 ~ 2011/1/4 | | | | | | 28,000,000 | |

千葉信用金庫

| 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 | 累積ホートフォリオ デフォルト金額 | 免責金額 | 免責超過金額※2 |
|------------------------|-----------------|-------------|----------------|---------|----------------------|------------|----------|
| 2007/9/27 ~ 2007/12/20 | 1,384,000,000 | 38,421,000 | 1,345,579,000 | 0 | 0 | 52,000,000 | 0 |
| 2007/12/21 ~ 2008/3/21 | 1,345,579,000 | 115,263,000 | 1,230,316,000 | 0 | 0 | 52,000,000 | 0 |
| 2008/3/22 ~ 2008/6/20 | 1,230,316,000 | 115,263,000 | 1,115,053,000 | 0 | 0 | 52,000,000 | 0 |
| 2008/6/21 ~ 2008/9/22 | 1,115,053,000 | | | | | 52,000,000 | |
| 2008/9/23 ~ 2008/12/22 | | | | | | 52,000,000 | |
| 2008/12/23 ~ 2009/3/23 | | | | | | 52,000,000 | |
| 2009/3/24 ~ 2009/6/22 | | | | | | 52,000,000 | |
| 2009/6/23 ~ 2007/9/24 | | | | | | 52,000,000 | |
| 2007/9/25 ~ 2009/12/21 | | | | | | 52,000,000 | |
| 2009/12/22 ~ 2010/3/23 | | | | | | 52,000,000 | |
| 2010/3/24 ~ 2010/6/21 | | | | | | 52,000,000 | |
| 2010/6/22 ~ 2010/11/1 | | | | | | 52,000,000 | |
| 2010/11/2 ~ 2011/1/4 | | | | | | 52,000,000 | |

尾西信用金庫

| 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 | 累積ホートフォリオ デフォルト金額 | 免責金額 | 免責超過金額※2 |
|------------------------|-----------------|-------------|----------------|---------|----------------------|------------|----------|
| 2007/9/27 ~ 2007/12/20 | 965,000,000 | 26,776,000 | 938,224,000 | 0 | 0 | 39,000,000 | 0 |
| 2007/12/21 ~ 2008/3/21 | 938,224,000 | 80,328,000 | 857,896,000 | 0 | 0 | 39,000,000 | 0 |
| 2008/3/22 ~ 2008/6/20 | 857,896,000 | 80,328,000 | 777,568,000 | 0 | 0 | 39,000,000 | 0 |
| 2008/6/21 ~ 2008/9/22 | 777,568,000 | | | | | 39,000,000 | |
| 2008/9/23 ~ 2008/12/22 | | | | | | 39,000,000 | |
| 2008/12/23 ~ 2009/3/23 | | | | | | 39,000,000 | |
| 2009/3/24 ~ 2009/6/22 | | | | | | 39,000,000 | |
| 2009/6/23 ~ 2007/9/24 | | | | | | 39,000,000 | |
| 2007/9/25 ~ 2009/12/21 | | | | | | 39,000,000 | |
| 2009/12/22 ~ 2010/3/23 | | | | | | 39,000,000 | |
| 2010/3/24 ~ 2010/6/21 | | | | | | 39,000,000 | |
| 2010/6/22 ~ 2010/11/1 | | | | | | 39,000,000 | |
| 2010/11/2 ~ 2011/1/4 | | | | | | 39,000,000 | |

滋賀中央信用金庫

| 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 | 累積ホートフォリオ デフォルト金額 | 免責金額 | 免責超過金額※2 |
|------------------------|-----------------|-------------|----------------|---------|----------------------|------------|----------|
| 2007/9/27 ~ 2007/12/20 | 403,000,000 | 11,183,000 | 391,817,000 | 0 | 0 | 37,000,000 | 0 |
| 2007/12/21 ~ 2008/3/21 | 391,817,000 | 33,549,000 | 358,268,000 | 0 | 0 | 37,000,000 | 0 |
| 2008/3/22 ~ 2008/6/20 | 358,268,000 | 33,133,000 | 325,135,000 | 0 | 0 | 37,000,000 | 0 |
| 2008/6/21 ~ 2008/9/22 | 325,135,000 | | | | | 37,000,000 | |
| 2008/9/23 ~ 2008/12/22 | | | | | | 37,000,000 | |
| 2008/12/23 ~ 2009/3/23 | | | | | | 37,000,000 | |
| 2009/3/24 ~ 2009/6/22 | | | | | | 37,000,000 | |
| 2009/6/23 ~ 2007/9/24 | | | | | | 37,000,000 | |
| 2007/9/25 ~ 2009/12/21 | | | | | | 37,000,000 | |
| 2009/12/22 ~ 2010/3/23 | | | | | | 37,000,000 | |
| 2010/3/24 ~ 2010/6/21 | | | | | | 37,000,000 | |
| 2010/6/22 ~ 2010/11/1 | | | | | | 37,000,000 | |
| 2010/11/2 ~ 2011/1/4 | | | | | | 37,000,000 | |

「地域金融機関CLO シンセティック型(株式会社こすもす2007)」発行後情報開示サマリー
(平成20年6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 |
|------------------------|-----------------|-------------|----------------|------------|----------------------|------------|----------|
| 2007/9/27 ~ 2007/12/20 | 535,000,000 | 14,846,000 | 520,154,000 | 0 | 0 | 33,000,000 | 0 |
| 2007/12/21 ~ 2008/3/21 | 520,154,000 | 71,206,000 | 448,948,000 | 29,167,000 | 29,167,000 | 33,000,000 | 0 |
| 2008/3/22 ~ 2008/6/20 | 448,948,000 | 41,208,000 | 407,740,000 | 0 | 29,167,000 | 33,000,000 | 0 |
| 2008/6/21 ~ 2008/9/22 | 407,740,000 | | | | | 33,000,000 | |
| 2008/9/23 ~ 2008/12/22 | | | | | | 33,000,000 | |
| 2008/12/23 ~ 2009/3/23 | | | | | | 33,000,000 | |
| 2009/3/24 ~ 2009/6/22 | | | | | | 33,000,000 | |
| 2009/6/23 ~ 2007/9/24 | | | | | | 33,000,000 | |
| 2007/9/25 ~ 2009/12/21 | | | | | | 33,000,000 | |
| 2009/12/22 ~ 2010/3/23 | | | | | | 33,000,000 | |
| 2010/3/24 ~ 2010/6/21 | | | | | | 33,000,000 | |
| 2010/6/22 ~ 2010/11/1 | | | | | | 33,000,000 | |
| 2010/11/2 ~ 2011/1/4 | | | | | | 33,000,000 | |

淡路信用金庫

| 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 |
|------------------------|-----------------|-------------|----------------|------------|----------------------|------------|----------|
| 2007/9/27 ~ 2007/12/20 | 980,000,000 | 27,202,000 | 952,798,000 | 0 | 0 | 43,000,000 | 0 |
| 2007/12/21 ~ 2008/3/21 | 952,798,000 | 81,606,000 | 871,192,000 | 0 | 0 | 43,000,000 | 0 |
| 2008/3/22 ~ 2008/6/20 | 871,192,000 | 121,890,000 | 749,302,000 | 36,633,265 | 36,633,265 | 43,000,000 | 0 |
| 2008/6/21 ~ 2008/9/22 | 749,302,000 | | | | | 43,000,000 | |
| 2008/9/23 ~ 2008/12/22 | | | | | | 43,000,000 | |
| 2008/12/23 ~ 2009/3/23 | | | | | | 43,000,000 | |
| 2009/3/24 ~ 2009/6/22 | | | | | | 43,000,000 | |
| 2009/6/23 ~ 2007/9/24 | | | | | | 43,000,000 | |
| 2007/9/25 ~ 2009/12/21 | | | | | | 43,000,000 | |
| 2009/12/22 ~ 2010/3/23 | | | | | | 43,000,000 | |
| 2010/3/24 ~ 2010/6/21 | | | | | | 43,000,000 | |
| 2010/6/22 ~ 2010/11/1 | | | | | | 43,000,000 | |
| 2010/11/2 ~ 2011/1/4 | | | | | | 43,000,000 | |

大分みらい信用金庫

| 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 |
|------------------------|-----------------|-------------|----------------|---------|----------------------|------------|----------|
| 2007/9/27 ~ 2007/12/20 | 315,000,000 | 8,738,000 | 306,262,000 | 0 | 0 | 43,000,000 | 0 |
| 2007/12/21 ~ 2008/3/21 | 306,262,000 | 26,214,000 | 280,048,000 | 0 | 0 | 43,000,000 | 0 |
| 2008/3/22 ~ 2008/6/20 | 280,048,000 | 26,214,000 | 253,834,000 | 0 | 0 | 43,000,000 | 0 |
| 2008/6/21 ~ 2008/9/22 | 253,834,000 | | | | | 43,000,000 | |
| 2008/9/23 ~ 2008/12/22 | | | | | | 43,000,000 | |
| 2008/12/23 ~ 2009/3/23 | | | | | | 43,000,000 | |
| 2009/3/24 ~ 2009/6/22 | | | | | | 43,000,000 | |
| 2009/6/23 ~ 2007/9/24 | | | | | | 43,000,000 | |
| 2007/9/25 ~ 2009/12/21 | | | | | | 43,000,000 | |
| 2009/12/22 ~ 2010/3/23 | | | | | | 43,000,000 | |
| 2010/3/24 ~ 2010/6/21 | | | | | | 43,000,000 | |
| 2010/6/22 ~ 2010/11/1 | | | | | | 43,000,000 | |
| 2010/11/2 ~ 2011/1/4 | | | | | | 43,000,000 | |

※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(株式会社こすもす2007)

業種分布

2008/06/06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 | 60 | 37.5% | 1 | 25.0% |
| 卸売・小売業 | 70 | 43.8% | 2 | 50.0% |
| 不動産業 | 0 | 0.0% | 0 | 0.0% |
| 飲食店、宿泊業 | 30 | 18.8% | 1 | 25.0% |
| 教育、学習支援行 | 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 | 160 | 100% | 4 | 100% |

1 2 3 4 5 (単位:百万円)

| | 1 株式会社 岩手銀行 | | | | 2 株式会社 大分銀行 | | | | 3 株式会社 北日本銀行 | | | | 4 株式会社 豊和銀行 | | | | 5 株式会社 宮崎太陽銀行 | | | |
|-------------------|-------------|-------|----|-------|-------------|------|----|------|--------------|------|----|------|-------------|------|----|------|---------------|------|----|------|
| | 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% | 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 | 60 | 75.0% | 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% |
| 卸売・小売業 | 20 | 25.0% | 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% |
| 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、学習支援行 | 0 | 0.0% | 0 | 0.0% | 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 | 80 | 100% | 2 | 100% | 0 | 0% | 0 | 0% | 0 | 0% | 0 | 0% | 0 | 0% | 0 | 0% | 0 | 0% | 0 | 0% |

6 7 8 9 10 (単位:百万円)

| | 6 福島信用金庫 | | | | 7 千葉信用金庫 | | | | 8 尾西信用金庫 | | | | 9 滋賀中央信用金庫 | | | | 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 |
| 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% | 30 | 100.0% | 1 | 100.0% |
| 教育、学習支援行 | 0 | 0.0% | 0 | 0.0% | 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% | 30 | 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(株式会社こすもす2007)

業種分布

2008/06/06現在

| | 11 (単位:百万円) | | | | 12 (単位:百万円) | | | |
|-------------------|-------------|--------|-----------|--------|-------------|------|-----------|------|
| | 淡路信用金庫 | | 大分みらい信用金庫 | | 淡路信用金庫 | | 大分みらい信用金庫 | |
| | 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% |
| 建設業 | 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% |
| 電気・ガス・熱供給・水道業 | 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% |
| 運輸業 | 0 | 0.0% | 0 | 0.0% | 0 | 0.0% | 0 | 0.0% |
| 卸売・小売業 | 50 | 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% |
| 飲食店、宿泊業 | 0 | 0.0% | 0 | 0.0% | 0 | 0.0% | 0 | 0.0% |
| 教育、学習支援行 | 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% |
| 総計 | 50 | 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(株式会社こすもす2007)

貸付額分布

2008/06/06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 | 20 | 12.5% | 1 | 25.0% |
| 20百万円超 30百万円以下 | 30 | 18.8% | 1 | 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 | 50 | 31.3% | 1 | 25.0% |
| 50百万円超 60百万円以下 | 60 | 37.5% | 1 | 25.0% |
| 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 | 160 | 100% | 4 | 100% |

| (単位:百万円) | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
|-----------------|----|-------|----|-------------|----|------|----|--------------|----|------|----|-------------|----|------|----|---------------|----|------|----|------|
| 1 株式会社 岩手銀行 | | | | 2 株式会社 大分銀行 | | | | 3 株式会社 北日本銀行 | | | | 4 株式会社 豊和銀行 | | | | 5 株式会社 宮崎太陽銀行 | | | | |
| | 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 | 20 | 25.0% | 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% |
| 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 | 60 | 75.0% | 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% |
| 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 | 80 | 100% | 2 | 100% | 0 | 0% | 0 | 0% | 0 | 0% | 0 | 0% | 0 | 0% | 0 | 0% | 0 | 0% | 0 | 0% |

| (単位:百万円) | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
|-----------------|----|------|----|----------|----|------|----|----------|----|------|----|------------|----|------|----|-----------|----|--------|----|--------|
| 6 福島信用金庫 | | | | 7 千葉信用金庫 | | | | 8 尾西信用金庫 | | | | 9 滋賀中央信用金庫 | | | | 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 |
| 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% | 30 | 100.0% | 1 | 100.0% |
| 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% | 30 | 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(株式会社こすもす2007)

貸付額分布

2008/06/06現在

| | | 11 (単位:百万円) | | | | 12 (単位:百万円) | | | |
|---------|----------|-------------|--------|----|--------|-------------|------|----|------|
| | | 淡路信用金庫 | | | | 大分みらい信用金庫 | | | |
| | | 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% |
| 10百万円超 | 20百万円以下 | 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% |
| 30百万円超 | 40百万円以下 | 0 | 0.0% | 0 | 0.0% | 0 | 0.0% | 0 | 0.0% |
| 40百万円超 | 50百万円以下 | 50 | 100.0% | 1 | 100.0% | 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% |
| 60百万円超 | 70百万円以下 | 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% |
| 80百万円超 | 90百万円以下 | 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% |
| 100百万円超 | | 0 | 0.0% | 0 | 0.0% | 0 | 0.0% | 0 | 0.0% |
| 総計 | | 50 | 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(株式会社こすもす2007)

2008/06/06現在

CRDモデル3 累積1年デフォルト確立分布

(単位:百万円)

| | | 合計 | | | |
|--------|--------|-----|-------|----|-------|
| | | 金額 | 比率 | 件数 | 比率 |
| 0.1%以下 | 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 | 30 | 18.8% | 1 | 25.0% |
| 0.3%超 | 0.4%以下 | 0 | 0.0% | 0 | 0.0% |
| 0.4%超 | 0.5%以下 | 50 | 31.3% | 1 | 25.0% |
| 0.5%超 | 0.6%以下 | 0 | 0.0% | 0 | 0.0% |
| 0.6%超 | 0.7%以下 | 20 | 12.5% | 1 | 25.0% |
| 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 | 60 | 37.5% | 1 | 25.0% |
| 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 | | 160 | 100% | 4 | 100% |

| | | 1 株式会社 岩手銀行 | | | | 2 株式会社 大分銀行 | | | | 3 株式会社 北日本銀行 | | | | 4 株式会社 豊和銀行 | | | | 5 株式会社 宮崎太陽銀行 | | | |
|--------|--------|-------------|-------|----|-------|-------------|------|----|------|--------------|------|----|------|-------------|------|----|------|---------------|------|----|------|
| | | 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 | 0.1%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 | 20 | 25.0% | 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% |
| 0.7%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 | 60 | 75.0% | 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% |
| 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 | | 80 | 100% | 2 | 100% | 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(株式会社こすもす2007)

CRDモデル3 累積1年デフォルト確立分布

2008/06/06現在
(単位:百万円)

| | 6 福島信用金庫 | | | | 7 千葉信用金庫 | | | | 8 尾西信用金庫 | | | | 9 滋賀中央信用金庫 | | | | 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% | 30 | 100.0% | 1 | 100.0% |
| 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% | 30 | 100% | 1 | 100% |

| | 11 淡路信用金庫 | | | | 12 大分みらい信用金庫 | | | |
|--------------|-----------|--------|----|--------|--------------|------|----|------|
| | 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% |
| 0.1%超 0.2%以下 | 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% |
| 0.3%超 0.4%以下 | 0 | 0.0% | 0 | 0.0% | 0 | 0.0% | 0 | 0.0% |
| 0.4%超 0.5%以下 | 50 | 100.0% | 1 | 100.0% | 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% |
| 0.6%超 0.7%以下 | 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% |
| 0.8%超 0.9%以下 | 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% |
| 1.0%超 1.1%以下 | 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% |
| 1.2%超 1.3%以下 | 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% |
| 1.4%超 1.5%以下 | 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% |
| 1.6%超 1.7%以下 | 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% |
| 1.8%超 1.9%以下 | 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% |
| 2.0%超 | 0 | 0.0% | 0 | 0.0% | 0 | 0.0% | 0 | 0.0% |
| 総計 | 50 | 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(株式会社こすもす2007)

RDB中小企業クレジットモデルデフォルト確立分布
(単位:百万円)

2008/06/06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 | | 80 | 50.0% | 2 | 50.0% |
| 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 | | 20 | 12.5% | 1 | 25.0% |
| 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 | | 60 | 37.5% | 1 | 25.0% |
| 総計 | | 160 | 100% | 4 | 100% |

| | | 1 株式会社 岩手銀行 | | | | 2 株式会社 大分銀行 | | | | 3 株式会社 北日本銀行 | | | | 4 株式会社 豊和銀行 | | | | 5 株式会社 宮崎太陽銀行 | | | |
|--------------|--|-------------|-------|----|-------|-------------|------|----|------|--------------|------|----|------|-------------|------|----|------|---------------|------|----|------|
| | | 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 | | 20 | 25.0% | 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% |
| 0.8%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 | | 60 | 75.0% | 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% |
| 総計 | | 80 | 100% | 2 | 100% | 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(株式会社こすもす2007)

RDB中小企業クレジットモデルデフォルト確立分布

2008/06/06現在

(単位:百万円)

| | 6 福島信用金庫 | | | | 7 千葉信用金庫 | | | | 8 尾西信用金庫 | | | | 9 滋賀中央信用金庫 | | | | 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% | 30 | 100.0% | 1 | 100.0% |
| 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% | 30 | 100% | 1 | 100% |

| | 11 淡路信用金庫 | | | | 12 大分みらい信用金庫 | | | |
|--------------|-----------|--------|----|--------|--------------|------|----|------|
| | 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% |
| 0.1%超 0.2%以下 | 0 | 0.0% | 0 | 0.0% | 0 | 0.0% | 0 | 0.0% |
| 0.2%超 0.3%以下 | 50 | 100.0% | 1 | 100.0% | 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% |
| 0.4%超 0.5%以下 | 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% |
| 0.6%超 0.7%以下 | 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% |
| 0.8%超 0.9%以下 | 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% |
| 1.0%超 1.1%以下 | 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% |
| 1.2%超 1.3%以下 | 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% |
| 1.4%超 1.5%以下 | 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% |
| 1.6%超 1.7%以下 | 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% |
| 1.8%超 1.9%以下 | 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% |
| 2.0%超 | 0 | 0.0% | 0 | 0.0% | 0 | 0.0% | 0 | 0.0% |
| 総計 | 50 | 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(株式会社こすもす2007)

2008/06/06現在

リスクカルク日本版v3.1デフォルト確立分布
(単位:百万円)

| | | 合計 | | | |
|--------|--------|-----|-------|----|-------|
| | | 金額 | 比率 | 件数 | 比率 |
| 0.1%以下 | 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 | 50 | 31.3% | 1 | 25.0% |
| 0.3%超 | 0.4%以下 | 50 | 31.3% | 2 | 50.0% |
| 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 | 0 | 0.0% | 0 | 0.0% |
| 1.7%超 | 1.8%以下 | 60 | 37.5% | 1 | 25.0% |
| 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 | | 160 | 100% | 4 | 100% |

| | | 1 株式会社 岩手銀行 | | | | 2 株式会社 大分銀行 | | | | 3 株式会社 北日本銀行 | | | | 4 株式会社 豊和銀行 | | | | 5 株式会社 宮崎太陽銀行 | | | |
|--------|--------|-------------|-------|----|-------|-------------|------|----|------|--------------|------|----|------|-------------|------|----|------|---------------|------|----|------|
| | | 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 | 0.1%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 | 20 | 25.0% | 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% |
| 0.4%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 | 60 | 75.0% | 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% |
| 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 | | 80 | 100% | 2 | 100% | 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(株式会社こすもす2007)

リスクカルク日本版v3.1デフォルト確立分布

2008/06/06現在

(単位:百万円)

| | | 6 福島信用金庫 | | | | 7 千葉信用金庫 | | | | 8 尾西信用金庫 | | | | 9 滋賀中央信用金庫 | | | | 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% | 30 | 100.0% | 1 | 100.0% |
| 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% | 30 | 100% | 1 | 100% |

| | | 11 淡路信用金庫 | | | | 12 大分みらい信用金庫 | | | |
|--------------|--|-----------|--------|----|--------|--------------|------|----|------|
| | | 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% |
| 0.1%超 0.2%以下 | | 0 | 0.0% | 0 | 0.0% | 0 | 0.0% | 0 | 0.0% |
| 0.2%超 0.3%以下 | | 50 | 100.0% | 1 | 100.0% | 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% |
| 0.4%超 0.5%以下 | | 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% |
| 0.6%超 0.7%以下 | | 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% |
| 0.8%超 0.9%以下 | | 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% |
| 1.0%超 1.1%以下 | | 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% |
| 1.2%超 1.3%以下 | | 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% |
| 1.4%超 1.5%以下 | | 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% |
| 1.6%超 1.7%以下 | | 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% |
| 1.8%超 1.9%以下 | | 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% |
| 2.0%超 | | 0 | 0.0% | 0 | 0.0% | 0 | 0.0% | 0 | 0.0% |
| 総計 | | 50 | 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(株式会社こすもす2007)

【デフォルト債権】

デフォルト債権／延滞債権一覧

2008/06/06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 岩手銀行 | 運輸業 | 法的破綻等(破産手続開始) | 2008/04/07 | 2008/05/29 | 51,670,000 | 51,670,000 | 60,000,000 |
| 株式会社 岩手銀行 | 卸売・小売業 | 法的破綻等(破産手続開始) | 2008/04/16 | 2008/05/29 | 16,670,000 | 16,670,000 | 20,000,000 |
| 滋賀中央信用金庫 | 製造業 | 延滞 | 2008/04/20 | 未確定 | 12,504,000 | 0 | 15,000,000 |
| 大阪信用金庫 | 飲食店、宿泊業 | 法的破綻等(破産手続開始) | 2007/10/24 | 2008/03/03 | 29,167,000 | 29,167,000 | 30,000,000 |
| 大阪信用金庫 | 製造業 | 延滞 | 2008/02/20 | 未確定 | 8,892,000 | 0 | 10,000,000 |
| 淡路信用金庫 | 卸売・小売業 | 法的破綻等(民事再生手続開始) | 2008/04/15 | 2008/05/29 | 41,672,000 | 36,633,265 | 50,000,000 |

注1: 延滞とは、延滞通知が提出されており参照債務の減額が停止しているもの。

(ただし、本レポート基準日時点においてクレジットイベント通知の提出は受けていない。なお、事由発生日が休日の場合、翌営業日が実質の延滞発生となる。)

注2: 未確定とは、クレジットイベント認定又は評価手続き未了によりデフォルト金額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、条件緩和による評価額算定の結果、あるい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。