

「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9月5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: 政策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) ¥12,122,000(注4) 免責金額(合計) ¥130,633,265(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9月5日時点
参照債務残高	¥7,422,000,000	¥5,245,496,000
参照債務残高率	100.00%	70.67%
クレジットイベント発生率(注1)	0.00%	0.15%
累積クレジットイベント発生率(注2)	0.00%	1.92%
参照債務	310件	305件
一参照債務あたり平均貸出額	¥23,941,935	¥17,198,347

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を、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9月5日)	2008.6.7~ 2008.9.5	累積	免責金額	シニア劣後 上限金額
岩手銀行	¥881,000,000	¥579,740,000	¥0	¥68,340,000	¥61,000,000	
大分銀行	¥365,000,000	¥263,740,000	¥0	¥0	¥55,000,000	
北日本銀行	¥587,000,000	¥424,070,000	¥0	¥0	¥39,000,000	
豊和銀行	¥110,000,000	¥79,530,000	¥0	¥0	¥14,000,000	
宮崎太陽銀行	¥417,000,000	¥301,260,000	¥0	¥0	¥28,000,000	
福島信用金庫	¥480,000,000	¥346,860,000	¥0	¥0	¥28,000,000	
千葉信用金庫	¥1,384,000,000	¥999,790,000	¥0	¥0	¥52,000,000	
尾西信用金庫	¥965,000,000	¥697,240,000	¥0	¥0	¥39,000,000	
滋賀中央信用金庫	¥403,000,000	¥292,814,000	¥0	¥0	¥37,000,000	
大阪信用金庫	¥535,000,000	¥359,306,000	¥8,615,000	¥37,782,000	¥33,000,000	
淡路信用金庫	¥980,000,000	¥673,526,000	¥0	¥36,633,265	¥43,000,000	
大分みらい信用金庫	¥315,000,000	¥227,620,000	¥0	¥0	¥43,000,000	
合計	¥7,422,000,000	¥5,245,496,000	¥8,615,000	¥142,755,265	¥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9月5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	606,999,000	5,245,496,000	8,615,000	142,755,265	472,000,000	12,122,000
2008/9/23 ~ 2008/12/22	5,245,496,000					472,000,000	
2008/12/23 ~ 2009/3/23						472,000,000	
2009/3/24 ~ 2009/6/22						472,000,000	
2009/6/23 ~ 2007/9/24						472,000,000	
2007/9/25 ~ 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	65,601,000	579,740,000	0	68,340,000	61,000,000	7,340,000
2008/9/23 ~ 2008/12/22	579,740,000					61,000,000	
2008/12/23 ~ 2009/3/23						61,000,000	
2009/3/24 ~ 2009/6/22						61,000,000	
2009/6/23 ~ 2007/9/24						61,000,000	
2007/9/25 ~ 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	30,378,000	263,740,000	0	0	55,000,000	0
2008/9/23 ~ 2008/12/22	263,740,000					55,000,000	
2008/12/23 ~ 2009/3/23						55,000,000	
2009/3/24 ~ 2009/6/22						55,000,000	
2009/6/23 ~ 2007/9/24						55,000,000	
2007/9/25 ~ 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	48,879,000	424,070,000	0	0	39,000,000	0
2008/9/23 ~ 2008/12/22	424,070,000					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	

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	9,141,000	79,530,000	0	0	14,000,000	0
2008/9/23 ~ 2008/12/22	79,530,000					14,000,000	
2008/12/23 ~ 2009/3/23						14,000,000	
2009/3/24 ~ 2009/6/22						14,000,000	
2009/6/23 ~ 2007/9/24						14,000,000	
2007/9/25 ~ 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9月5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	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	34,722,000	301,260,000	0	0	28,000,000	0
2008/9/23 ~ 2008/12/22	301,260,000					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	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	39,942,000	346,860,000	0	0	28,000,000	0
2008/9/23 ~ 2008/12/22	346,860,000					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	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	115,263,000	999,790,000	0	0	52,000,000	0
2008/9/23 ~ 2008/12/22	999,790,000					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	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	80,328,000	697,240,000	0	0	39,000,000	0
2008/9/23 ~ 2008/12/22	697,240,000					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	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	32,321,000	292,814,000	0	0	37,000,000	0
2008/9/23 ~ 2008/12/22	292,814,000					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9月5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	48,434,000	359,306,000	8,615,000	37,782,000	33,000,000	4,782,000
2008/9/23 ~ 2008/12/22	359,306,000					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	75,776,000	673,526,000	0	36,633,265	43,000,000	0
2008/9/23 ~ 2008/12/22	673,526,000					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	26,214,000	227,620,000	0	0	43,000,000	0
2008/9/23 ~ 2008/12/22	227,620,000					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

2008/09/05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	10	5.9%	1	20.0%
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	35.3%	1	20.0%
卸売・小売業	70	41.2%	2	40.0%
不動産業	0	0.0%	0	0.0%
飲食店、宿泊業	30	17.6%	1	20.0%
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	170	100%	5	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%	10	25.0%	1	50.0%
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	75.0%	1	50.0%
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%	40	100%	2	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

2008/09/05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、学習支援業	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

2008/09/05現在

(単位:百万円)

合計				
	金額	比率	件数	比率
10百万円以下	10	5.9%	1	20.0%
10百万円超 20百万円以下	20	11.8%	1	20.0%
20百万円超 30百万円以下	30	17.6%	1	20.0%
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	29.4%	1	20.0%
50百万円超 60百万円以下	60	35.3%	1	20.0%
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	170	100%	5	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
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%

	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%	10	25.0%	1	50.0%
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	75.0%	1	50.0%
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%	40	100%	2	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

2008/09/05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)

2008/09/05現在

CRDモデル3 累積1年デフォルト確率分布

(単位:百万円)

		合計			
		金額	比率	件数	比率
0.1%以下		0	0.0%	0	0.0%
0.1%超 0.2%以下		0	0.0%	0	0.0%
0.2%超 0.3%以下		30	17.6%	1	20.0%
0.3%超 0.4%以下		0	0.0%	0	0.0%
0.4%超 0.5%以下		50	29.4%	1	20.0%
0.5%超 0.6%以下		10	5.9%	1	20.0%
0.6%超 0.7%以下		20	11.8%	1	20.0%
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	35.3%	1	20.0%
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		170	100%	5	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		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年デフォルト確率分布

2008/09/05現在

		6				7				8				9				10			
		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			
		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	75.0%	1	50.0%
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%	10	25.0%	1	50.0%
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%	40	100%	2	100%

		11				12			
		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
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率分布
(単位:百万円)

2008/09/05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	47.1%	2	40.0%
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	11.8%	1	20.0%
0.8%超 0.9%以下		0	0.0%	0	0.0%
0.9%超 1.0%以下		10	5.9%	1	20.0%
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	35.3%	1	20.0%
総計		170	100%	5	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率分布

2008/09/05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	75.0%	1	50.0%
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%	10	25.0%	1	50.0%
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%	40	100%	2	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)

2008/09/05現在

リスクカルク日本版v3.1デフォルト確率分布
(単位:百万円)

		合計			
		金額	比率	件数	比率
0.1%以下		0	0.0%	0	0.0%
0.1%超 0.2%以下		0	0.0%	0	0.0%
0.2%超 0.3%以下		50	29.4%	1	20.0%
0.3%超 0.4%以下		60	35.3%	3	60.0%
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	35.3%	1	20.0%
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		170	100%	5	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		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デフォルト確率分布

2008/09/05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%	40	100.0%	2	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%	40	100%	2	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

2008/09/05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)	2008/4/7	2008/5/29	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)	2008/4/16	2008/5/29	16,670,000	16,670,000	20,000,000
株式会社 岩手銀行	卸売・小売業	延滞	2008/6/20	未確定	15,560,000	0	20,000,000
滋賀中央信用金庫	製造業	条件緩和	2008/6/30	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	2008/3/3	29,167,000	29,167,000	30,000,000
大阪信用金庫	製造業	支払不履行	2008/5/20	2008/9/2	8,892,000	8,615,000	10,000,000
大阪信用金庫	卸売・小売業	延滞	2008/6/20	未確定	23,336,000	0	30,000,000
淡路信用金庫	卸売・小売業	法的破綻等(民事再生手続開始)	2008/4/15	2008/5/29	41,672,000	36,633,265	50,000,000
淡路信用金庫	製造業	延滞	2008/7/20	未確定	22,503,000	0	30,000,000
淡路信用金庫	卸売・小売業	延滞	2008/7/20	未確定	22,503,000	0	30,000,000

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。