

「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22年6月7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: Aaa AAA

(注1)3か月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: 日本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) ¥232,673,438(注4) 免責金額(合計) ¥248,977,999(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22年6月7日時点
参照債務残高	¥7,422,000,000	¥863,618,000(注3)
参照債務残高率	100.00%	11.64%
クレジットイベント発生率(注1)	0.00%	1.71%
累積クレジットイベント発生率(注2)	0.00%	6.49%
参照債務	310件	261件
一参照債務あたり平均貸出額	¥23,941,935	¥3,308,881

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(%)

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

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 (22年6月7日)	2010.3.9~ 2010.6.7	累積	免責金額	シニア劣後 上限金額
岩手銀行	¥881,000,000	¥77,484,000	¥0	¥191,370,023	¥61,000,000	
大分銀行	¥365,000,000	¥48,268,000	¥379,909	¥379,909	¥55,000,000	
北日本銀行	¥587,000,000	¥66,296,000	¥0	¥33,344,000	¥39,000,000	
豊和銀行	¥110,000,000	¥15,543,000	¥0	¥0	¥14,000,000	
宮崎太陽銀行	¥417,000,000	¥58,206,000	¥0	¥0	¥28,000,000	
福島信用金庫	¥480,000,000	¥67,266,000	¥0	¥0	¥28,000,000	
千葉信用金庫	¥1,384,000,000	¥165,488,000	¥9,175,000	¥25,014,000	¥52,000,000	
尾西信用金庫	¥965,000,000	¥134,944,000	¥0	¥0	¥39,000,000	
滋賀中央信用金庫	¥403,000,000	¥47,251,000	¥8,360,000	¥10,240,090	¥37,000,000	
大阪信用金庫	¥535,000,000	¥39,007,000	¥267,260	¥86,750,980	¥33,000,000	
淡路信用金庫	¥980,000,000	¥114,409,000	¥0	¥85,851,637	¥43,000,000	
大分みらい信用金庫	¥315,000,000	¥29,456,000	¥6,125,000	¥48,700,798	¥43,000,000	
合計	¥7,422,000,000	¥863,618,000	¥24,307,169	¥481,651,437	¥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22年6月7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	累積ホートフォ 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	646,311,000	4,599,185,000	39,943,090	182,698,355	472,000,000	43,818,265
2008/12/23 ~ 2009/3/23	4,599,185,000	742,440,000	3,856,745,000	110,781,971	293,480,326	472,000,000	121,256,236
2009/3/24 ~ 2009/6/22	3,856,745,000	681,861,000	3,174,884,000	81,769,144	375,249,470	472,000,000	148,844,380
2009/6/23 ~ 2007/9/24	3,174,884,000	612,705,000	2,562,179,000	27,514,000	402,763,470	472,000,000	176,358,380
2007/9/25 ~ 2009/12/21	2,562,179,000	565,609,000	1,996,570,000	27,533,000	430,296,470	472,000,000	203,891,380
2009/12/22 ~ 2010/3/23	1,996,570,000	574,587,000	1,421,983,000	27,047,798	457,344,268	472,000,000	226,705,380
2010/3/24 ~ 2010/6/21	1,421,983,000	558,365,000	863,618,000	24,307,169	481,651,437	472,000,000	232,673,438
2010/6/22 ~ 2010/11/1	863,618,000					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	累積ホートフォ 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	76,720,000	503,020,000	15,560,000	83,900,000	61,000,000	22,900,000
2008/12/23 ~ 2009/3/23	503,020,000	124,516,000	378,504,000	64,857,879	148,757,879	61,000,000	87,757,879
2009/3/24 ~ 2009/6/22	378,504,000	94,519,000	283,985,000	27,588,144	176,346,023	61,000,000	115,346,023
2009/6/23 ~ 2007/9/24	283,985,000	50,055,000	233,930,000	0	176,346,023	61,000,000	115,346,023
2007/9/25 ~ 2009/12/21	233,930,000	48,806,000	185,124,000	0	176,346,023	61,000,000	115,346,023
2009/12/22 ~ 2010/3/23	185,124,000	61,332,000	123,792,000	15,024,000	191,370,023	61,000,000	130,370,023
2010/3/24 ~ 2010/6/21	123,792,000	46,308,000	77,484,000	0	191,370,023	61,000,000	130,370,023
2010/6/22 ~ 2010/11/1	77,484,000					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	累積ホートフォ 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	30,378,000	233,362,000	0	0	55,000,000	0
2008/12/23 ~ 2009/3/23	233,362,000	30,378,000	202,984,000	0	0	55,000,000	0
2009/3/24 ~ 2009/6/22	202,984,000	30,378,000	172,606,000	0	0	55,000,000	0
2009/6/23 ~ 2007/9/24	172,606,000	30,378,000	142,228,000	0	0	55,000,000	0
2007/9/25 ~ 2009/12/21	142,228,000	30,378,000	111,850,000	0	0	55,000,000	0
2009/12/22 ~ 2010/3/23	111,850,000	30,378,000	81,472,000	0	0	55,000,000	0
2010/3/24 ~ 2010/6/21	81,472,000	33,204,000	48,268,000	379,909	379,909	55,000,000	0
2010/6/22 ~ 2010/11/1	48,268,000					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	累積ホートフォ 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	55,162,000	368,908,000	0	0	39,000,000	0
2008/12/23 ~ 2009/3/23	368,908,000	77,060,000	291,848,000	33,344,000	33,344,000	39,000,000	0
2009/3/24 ~ 2009/6/22	291,848,000	43,716,000	248,132,000	0	33,344,000	39,000,000	0
2009/6/23 ~ 2007/9/24	248,132,000	63,180,000	184,952,000	0	33,344,000	39,000,000	0
2007/9/25 ~ 2009/12/21	184,952,000	39,552,000	145,400,000	0	33,344,000	39,000,000	0
2009/12/22 ~ 2010/3/23	145,400,000	39,552,000	105,848,000	0	33,344,000	39,000,000	0
2010/3/24 ~ 2010/6/21	105,848,000	39,552,000	66,296,000	0	33,344,000	39,000,000	0
2010/6/22 ~ 2010/11/1	66,296,000					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	累積ホートフォ 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	9,141,000	70,389,000	0	0	14,000,000	0
2008/12/23 ~ 2009/3/23	70,389,000	9,141,000	61,248,000	0	0	14,000,000	0
2009/3/24 ~ 2009/6/22	61,248,000	9,141,000	52,107,000	0	0	14,000,000	0
2009/6/23 ~ 2007/9/24	52,107,000	9,141,000	42,966,000	0	0	14,000,000	0
2007/9/25 ~ 2009/12/21	42,966,000	9,141,000	33,825,000	0	0	14,000,000	0
2009/12/22 ~ 2010/3/23	33,825,000	9,141,000	24,684,000	0	0	14,000,000	0
2010/3/24 ~ 2010/6/21	24,684,000	9,141,000	15,543,000	0	0	14,000,000	0
2010/6/22 ~ 2010/11/1	15,543,000					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22年6月7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	34,722,000	301,260,000	0	0	28,000,000	0
2008/9/23 ~ 2008/12/22	301,260,000	34,722,000	266,538,000	0	0	28,000,000	0
2008/12/23 ~ 2009/3/23	266,538,000	34,722,000	231,816,000	0	0	28,000,000	0
2009/3/24 ~ 2009/6/22	231,816,000	34,722,000	197,094,000	0	0	28,000,000	0
2009/6/23 ~ 2007/9/24	197,094,000	34,722,000	162,372,000	0	0	28,000,000	0
2007/9/25 ~ 2009/12/21	162,372,000	34,722,000	127,650,000	0	0	28,000,000	0
2009/12/22 ~ 2010/3/23	127,650,000	34,722,000	92,928,000	0	0	28,000,000	0
2010/3/24 ~ 2010/6/21	92,928,000	34,722,000	58,206,000	0	0	28,000,000	0
2010/6/22 ~ 2010/11/1	58,206,000					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	39,942,000	346,860,000	0	0	28,000,000	0
2008/9/23 ~ 2008/12/22	346,860,000	39,942,000	306,918,000	0	0	28,000,000	0
2008/12/23 ~ 2009/3/23	306,918,000	39,942,000	266,976,000	0	0	28,000,000	0
2009/3/24 ~ 2009/6/22	266,976,000	39,942,000	227,034,000	0	0	28,000,000	0
2009/6/23 ~ 2007/9/24	227,034,000	39,942,000	187,092,000	0	0	28,000,000	0
2007/9/25 ~ 2009/12/21	187,092,000	39,942,000	147,150,000	0	0	28,000,000	0
2009/12/22 ~ 2010/3/23	147,150,000	39,942,000	107,208,000	0	0	28,000,000	0
2010/3/24 ~ 2010/6/21	107,208,000	39,942,000	67,266,000	0	0	28,000,000	0
2010/6/22 ~ 2010/11/1	67,266,000					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	115,263,000	999,790,000	0	0	52,000,000	0
2008/9/23 ~ 2008/12/22	999,790,000	115,263,000	884,527,000	0	0	52,000,000	0
2008/12/23 ~ 2009/3/23	884,527,000	125,263,000	759,264,000	0	0	52,000,000	0
2009/3/24 ~ 2009/6/22	759,264,000	136,923,000	622,341,000	15,839,000	15,839,000	52,000,000	0
2009/6/23 ~ 2007/9/24	622,341,000	125,263,000	497,078,000	0	15,839,000	52,000,000	0
2007/9/25 ~ 2009/12/21	497,078,000	106,353,000	390,725,000	0	15,839,000	52,000,000	0
2009/12/22 ~ 2010/3/23	390,725,000	110,530,000	280,195,000	0	15,839,000	52,000,000	0
2010/3/24 ~ 2010/6/21	280,195,000	114,707,000	165,488,000	9,175,000	25,014,000	52,000,000	0
2010/6/22 ~ 2010/11/1	165,488,000					52,000,000	
2010/11/2 ~ 2011/1/4						52,000,000	

2009/3/24~2009/6/22において繰上償還があったため参照債務減少額に繰上償還分を加算し、以降の残高を再計算している。

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	80,328,000	697,240,000	0	0	39,000,000	0
2008/9/23 ~ 2008/12/22	697,240,000	80,328,000	616,912,000	0	0	39,000,000	0
2008/12/23 ~ 2009/3/23	616,912,000	80,328,000	536,584,000	0	0	39,000,000	0
2009/3/24 ~ 2009/6/22	536,584,000	80,328,000	456,256,000	0	0	39,000,000	0
2009/6/23 ~ 2007/9/24	456,256,000	80,328,000	375,928,000	0	0	39,000,000	0
2007/9/25 ~ 2009/12/21	375,928,000	80,328,000	295,600,000	0	0	39,000,000	0
2009/12/22 ~ 2010/3/23	295,600,000	80,328,000	215,272,000	0	0	39,000,000	0
2010/3/24 ~ 2010/6/21	215,272,000	80,328,000	134,944,000	0	0	39,000,000	0
2010/6/22 ~ 2010/11/1	134,944,000					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	32,321,000	292,814,000	0	0	37,000,000	0
2008/9/23 ~ 2008/12/22	292,814,000	44,785,000	248,029,000	1,880,090	1,880,090	37,000,000	0
2008/12/23 ~ 2009/3/23	248,029,000	32,301,000	215,728,000	0	1,880,090	37,000,000	0
2009/3/24 ~ 2009/6/22	215,728,000	32,301,000	183,427,000	0	1,880,090	37,000,000	0
2009/6/23 ~ 2007/9/24	183,427,000	32,301,000	151,126,000	0	1,880,090	37,000,000	0
2007/9/25 ~ 2009/12/21	151,126,000	32,301,000	118,825,000	0	1,880,090	37,000,000	0
2009/12/22 ~ 2010/3/23	118,825,000	32,301,000	86,524,000	0	1,880,090	37,000,000	0
2010/3/24 ~ 2010/6/21	86,524,000	39,273,000	47,251,000	8,360,000	10,240,090	37,000,000	0
2010/6/22 ~ 2010/11/1	47,251,000					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22年6月7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	38,709,000	320,597,000	0	37,782,000	33,000,000	4,782,000
2008/12/23 ~ 2009/3/23	320,597,000	73,181,000	247,416,000	9,789,720	47,571,720	33,000,000	14,571,720
2009/3/24 ~ 2009/6/22	247,416,000	49,554,000	197,862,000	0	47,571,720	33,000,000	14,571,720
2009/6/23 ~ 2007/9/24	197,862,000	44,279,000	153,583,000	15,839,000	63,410,720	33,000,000	30,410,720
2007/9/25 ~ 2009/12/21	153,583,000	50,127,000	103,456,000	23,073,000	86,483,720	33,000,000	53,483,720
2009/12/22 ~ 2010/3/23	103,456,000	35,141,000	68,315,000	0	86,483,720	33,000,000	53,483,720
2010/3/24 ~ 2010/6/21	68,315,000	29,308,000	39,007,000	267,260	86,750,980	33,000,000	53,750,980
2010/6/22 ~ 2010/11/1	39,007,000					33,000,000	
2010/11/2 ~ 2011/1/4						33,000,000	

2009/3/24~2009/6/22において繰上償還があったため参照債務減少額に繰上償還分を加算し、以降の残高を再計算している。

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	94,947,000	578,579,000	22,503,000	59,136,265	43,000,000	16,136,265
2008/12/23 ~ 2009/3/23	578,579,000	94,392,000	484,187,000	2,790,372	61,926,637	43,000,000	18,926,637
2009/3/24 ~ 2009/6/22	484,187,000	70,779,000	413,408,000	0	61,926,637	43,000,000	18,926,637
2009/6/23 ~ 2007/9/24	413,408,000	81,900,000	331,508,000	11,675,000	73,601,637	43,000,000	30,601,637
2007/9/25 ~ 2009/12/21	331,508,000	72,743,000	258,765,000	4,460,000	78,061,637	43,000,000	35,061,637
2009/12/22 ~ 2010/3/23	258,765,000	76,073,000	182,692,000	7,790,000	85,851,637	43,000,000	42,851,637
2010/3/24 ~ 2010/6/21	182,692,000	68,283,000	114,409,000	0	85,851,637	43,000,000	42,851,637
2010/6/22 ~ 2010/11/1	114,409,000					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	26,214,000	201,406,000	0	0	43,000,000	0
2008/12/23 ~ 2009/3/23	201,406,000	21,216,000	180,190,000	0	0	43,000,000	0
2009/3/24 ~ 2009/6/22	180,190,000	59,558,000	120,632,000	38,342,000	38,342,000	43,000,000	0
2009/6/23 ~ 2007/9/24	120,632,000	21,216,000	99,416,000	0	38,342,000	43,000,000	0
2007/9/25 ~ 2009/12/21	99,416,000	21,216,000	78,200,000	0	38,342,000	43,000,000	0
2009/12/22 ~ 2010/3/23	78,200,000	25,147,000	53,053,000	4,233,798	42,575,798	43,000,000	0
2010/3/24 ~ 2010/6/21	53,053,000	23,597,000	29,456,000	6,125,000	48,700,798	43,000,000	5,700,798
2010/6/22 ~ 2010/11/1	29,456,000					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

2010/06/07現在

(単位:百万円)

	合計			
	金額	比率	件数	比率
農業, 林業	0	0.0%	0	0.0%
漁業	0	0.0%	0	0.0%
鉱業, 採石業, 砂利採取業	0	0.0%	0	0.0%
建設業	30	3.3%	1	3.0%
製造業	55	6.1%	3	9.1%
電気・ガス・熱供給・水道業	0	0.0%	0	0.0%
情報通信業	20	2.2%	1	3.0%
運輸業, 郵便業	95	10.5%	3	9.1%
卸売業, 小売業	595	65.7%	20	60.6%
金融業, 保険業	0	0.0%	0	0.0%
不動産業, 物品賃貸業	30	3.3%	1	3.0%
学術研究, 専門・技術サービス業	0	0.0%	0	0.0%
宿泊業, 飲食サービス業	60	6.6%	3	9.1%
生活関連サービス業, 娯楽業	20	2.2%	1	3.0%
教育, 学習支援業	0	0.0%	0	0.0%
医療, 福祉	0	0.0%	0	0.0%
複合サービス事業	0	0.0%	0	0.0%
サービス業(他に分類されないもの)	0	0.0%	0	0.0%
総計	905	100%	33	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
農業, 林業	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%
漁業	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%
鉱業, 採石業, 砂利採取業	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	20	6.8%	1	11.1%	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, 郵便業	80	27.1%	2	22.2%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
卸売業, 小売業	175	59.3%	5	55.6%	0	0.0%	0	0.0%	50	100.0%	1	100.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
金融業, 保険業	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, 物品賃貸業	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%
学術研究, 専門・技術サービス業	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%
宿泊業, 飲食サービス業	20	6.8%	1	11.1%	10	100.0%	1	100.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
生活関連サービス業, 娯楽業	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
教育, 学習支援業	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
医療, 福祉	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
複合サービス事業	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
サービス業(他に分類されないもの)	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
総計	295	100%	9	100%	10	100%	1	100%	50	100%	1	100%	0	0%	0	0%	0	0%	0	0%

注1: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)。

注2:平成21年9月7日以降については、日本標準産業分類(平成19年11月改定)に基づき業種分布表を表示している。

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

2010/06/07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
農業, 林業	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%
漁業	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%
鉱業, 採石業, 砂利採取業	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%	15	23.1%	1	50.0%	10	5.9%	1	12.5%
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, 郵便業	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%
卸売業, 小売業	0	0.0%	0	0.0%	60	100.0%	2	100.0%	0	0.0%	0	0.0%	50	76.9%	1	50.0%	130	76.5%	6	75.0%
金融業, 保険業	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, 物品賃貸業	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%
学術研究, 専門・技術サービス業	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%
宿泊業, 飲食サービス業	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	17.6%	1	12.5%
生活関連サービス業, 娯楽業	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
教育, 学習支援業	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
医療, 福祉	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
複合サービス事業	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
サービス業(他に分類されないもの)	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
総計	0	0%	0	0%	60	0%	2	100%	0	0%	0	0%	65	100%	2	100%	170	100%	8	100%

	11 淡路信用金庫				12 大分みらい信用金庫				13 0				14 0				15 0			
	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
農業, 林業	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%												
漁業	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%												
鉱業, 採石業, 砂利採取業	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%												
建設業	0	0.0%	0	0.0%	30	31.6%	1	25.0%												
製造業	30	18.8%	1	16.7%	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, 郵便業	0	0.0%	0	0.0%	15	15.8%	1	25.0%												
卸売業, 小売業	110	68.8%	4	66.7%	20	21.1%	1	25.0%												
金融業, 保険業	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%												
不動産業, 物品賃貸業	0	0.0%	0	0.0%	30	31.6%	1	25.0%												
学術研究, 専門・技術サービス業	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%												
宿泊業, 飲食サービス業	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%												
生活関連サービス業, 娯楽業	20	12.5%	1	16.7%	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%												
医療, 福祉	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%												
複合サービス事業	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	160	100%	6	100%	95	100%	4	100%												

注1: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)。

注2:平成21年9月7日以降については、日本標準産業分類(平成19年11月改定)に基づき業種分布表を表示している。

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

2010/06/07現在

(単位:百万円)

合計		金額	比率	件数	比率
10百万円以下		50	5.5%	5	15.2%
10百万円超 20百万円以下		210	23.2%	11	33.3%
20百万円超 30百万円以下		325	35.9%	11	33.3%
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		200	22.1%	4	12.1%
50百万円超 60百万円以下		120	13.3%	2	6.1%
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		905	100%	33	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%	10	100.0%	1	100.0%	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	100	33.9%	5	55.6%	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	25	8.5%	1	11.1%	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	50	16.9%	1	11.1%	0	0.0%	0	0.0%	50	100.0%	1	100.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
50百万円超 60百万円以下	120	40.7%	2	22.2%	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	295	100%	9	100%	10	100%	1	100%	50	100%	1	100%	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%	30	17.6%	3	37.5%
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%	15	23.1%	1	50.0%	20	11.8%	1	12.5%
20百万円超 30百万円以下	0	0.0%	0	0.0%	60	100.0%	2	100.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	120	70.6%	4	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%	50	76.9%	1	50.0%	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%	60	100%	2	100%	0	0%	0	0%	65	100%	2	100%	170	100%	8	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

2010/06/07現在
(単位:百万円)

		11				12				13				14				15			
		淡路信用金庫				大分みらい信用金庫				0				0				0			
		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	10	6.3%	1	16.7%	0	0.0%	0	0.0%													
10百万円超 20百万円以下	40	25.0%	2	33.3%	35	36.8%	2	50.0%													
20百万円超 30百万円以下	60	37.5%	2	33.3%	60	63.2%	2	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%													
40百万円超 50百万円以下	50	31.3%	1	16.7%	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	160	100%	6	100%	95	100%	4	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)

2010/06/07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		35	3.9%	2	6.1%
0.2%超 0.3%以下		70	7.7%	4	12.1%
0.3%超 0.4%以下		60	6.6%	2	6.1%
0.4%超 0.5%以下		90	9.9%	3	9.1%
0.5%超 0.6%以下		45	5.0%	3	9.1%
0.6%超 0.7%以下		100	11.0%	5	15.2%
0.7%超 0.8%以下		110	12.2%	2	6.1%
0.8%超 0.9%以下		50	5.5%	2	6.1%
0.9%超 1.0%以下		30	3.3%	1	3.0%
1.0%超 1.1%以下		55	6.1%	2	6.1%
1.1%超 1.2%以下		90	9.9%	2	6.1%
1.2%超 1.3%以下		30	3.3%	1	3.0%
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		50	5.5%	1	3.0%
1.6%超 1.7%以下		30	3.3%	1	3.0%
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	6.6%	2	6.1%
総計		905	100%	33	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		20	6.8%	1	11.1%	0	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		50	16.9%	1	11.1%	10	100.0%	1	100.0%	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		40	13.6%	2	22.2%	0	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	6.8%	1	11.1%	0	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		60	20.3%	1	11.1%	0	0.0%	0	0.0%	50	100.0%	1	100.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
0.8%超 0.9%以下		20	6.8%	1	11.1%	0	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		25	8.5%	1	11.1%	0	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	20.3%	1	11.1%	0	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		295	100%	9	100%	10	100%	1	100%	50	100%	1	100%	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

2010/06/07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%	40	23.5%	2	25.0%
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%	15	23.1%	1	50.0%	30	17.6%	2	25.0%
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%	40	23.5%	2	25.0%
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%	30	17.6%	1	12.5%
1.1%超 1.2%以下		0	0.0%	0	0.0%	30	50.0%	1	50.0%	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%	50	76.9%	1	50.0%	0	0.0%	0	0.0%
1.6%超 1.7%以下		0	0.0%	0	0.0%	30	50.0%	1	50.0%	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%	30	17.6%	1	12.5%
総計		0	0%	0	0%	60	100%	2	100%	0	0%	0	0%	65	100%	2	100%	170	100%	8	100%

		11				12				13				14				15			
		淡路信用金庫				大分みらい信用金庫				0				0				0			
		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%												
0.1%超 0.2%以下		20	12.5%	1	16.7%	15	15.8%	1	25.0%												
0.2%超 0.3%以下		10	6.3%	1	16.7%	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	31.3%	1	16.7%	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		20	12.5%	1	16.7%	20	21.1%	1	25.0%												
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		30	18.8%	1	16.7%	0	0.0%	0	0.0%												
0.9%超 1.0%以下		30	18.8%	1	16.7%	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%	30	31.6%	1	25.0%												
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%	30	31.6%	1	25.0%												
総計		160	100%	6	100%	95	100%	4	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)

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)

2010/06/07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		10	1.1%	1	3.0%
0.2%超 0.3%以下		80	8.8%	2	6.1%
0.3%超 0.4%以下		50	5.5%	1	3.0%
0.4%超 0.5%以下		110	12.2%	2	6.1%
0.5%超 0.6%以下		65	7.2%	3	9.1%
0.6%超 0.7%以下		40	4.4%	2	6.1%
0.7%超 0.8%以下		40	4.4%	2	6.1%
0.8%超 0.9%以下		40	4.4%	2	6.1%
0.9%超 1.0%以下		30	3.3%	2	6.1%
1.0%超 1.1%以下		70	7.7%	3	9.1%
1.1%超 1.2%以下		0	0.0%	0	0.0%
1.2%超 1.3%以下		20	2.2%	1	3.0%
1.3%超 1.4%以下		50	5.5%	1	3.0%
1.4%超 1.5%以下		90	9.9%	3	9.1%
1.5%超 1.6%以下		15	1.7%	1	3.0%
1.6%超 1.7%以下		50	5.5%	2	6.1%
1.7%超 1.8%以下		20	2.2%	1	3.0%
1.8%超 1.9%以下		10	1.1%	1	3.0%
1.9%超 2.0%以下		0	0.0%	0	0.0%
2.0%超		115	12.7%	3	9.1%
総計		905	100%	33	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		50	16.9%	1	11.1%	0	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		60	20.3%	1	11.1%	0	0.0%	0	0.0%	50	100.0%	1	100.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
0.5%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		40	13.6%	2	22.2%	0	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%	10	100.0%	1	100.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
0.9%超 1.0%以下		20	6.8%	1	11.1%	0	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		20	6.8%	1	11.1%	0	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		20	6.8%	1	11.1%	0	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		85	28.8%	2	22.2%	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		295	100%	9	100%	10	100%	1	100%	50	100%	1	100%	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

2010/06/07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	17.6%	1	12.5%
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%	40	23.5%	2	25.0%
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%	30	17.6%	1	12.5%
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	5.9%	1	12.5%
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%	20	11.8%	1	12.5%
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%	50	76.9%	1	50.0%	0	0.0%	0	0.0%
1.4%超 1.5%以下	0	0.0%	0	0.0%	30	50.0%	1	50.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	30	17.6%	1	12.5%
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%	15	23.1%	1	50.0%	0	0.0%	0	0.0%
1.6%超 1.7%以下	0	0.0%	0	0.0%	30	50.0%	1	50.0%	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%	10	5.9%	1	12.5%
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%	60	100%	2	100%	0	0%	0	0%	65	100%	2	100%	170	100%	8	100%

	11 淡路信用金庫				12 大分みらい信用金庫				13 0				14 0				15 0			
	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%												
0.1%超 0.2%以下	10	6.3%	1	16.7%	0	0.0%	0	0.0%												
0.2%超 0.3%以下	50	31.3%	1	16.7%	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	20	12.5%	1	16.7%	45	47.4%	2	50.0%												
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%	50	52.6%	2	50.0%												
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	30	18.8%	1	16.7%	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	20	12.5%	1	16.7%	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	30	18.8%	1	16.7%	0	0.0%	0	0.0%												
総計	160	100%	6	100%	95	100%	4	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)

2010/06/07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	0.1%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	145	16.0%	4	12.1%
0.3%超	0.4%以下	370	40.9%	13	39.4%
0.4%超	0.5%以下	60	6.6%	3	9.1%
0.5%超	0.6%以下	50	5.5%	2	6.1%
0.6%超	0.7%以下	110	12.2%	4	12.1%
0.7%超	0.8%以下	20	2.2%	1	3.0%
0.8%超	0.9%以下	0	0.0%	0	0.0%
0.9%超	1.0%以下	20	2.2%	1	3.0%
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	15	1.7%	1	3.0%
1.4%超	1.5%以下	10	1.1%	1	3.0%
1.5%超	1.6%以下	0	0.0%	0	0.0%
1.6%超	1.7%以下	20	2.2%	1	3.0%
1.7%超	1.8%以下	60	6.6%	1	3.0%
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		25	2.8%	1	3.0%
総計		905	100%	33	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	50	16.9%	1	11.1%	0	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	100	33.9%	3	33.3%	0	0.0%	0	0.0%	50	100.0%	1	100.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
0.4%超	0.5%以下	20	6.8%	1	11.1%	0	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	20	6.8%	1	11.1%	0	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%	10	100.0%	1	100.0%	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	20	6.8%	1	11.1%	0	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	20.3%	1	11.1%	0	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		25	8.5%	1	11.1%	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		295	100%	9	100%	10	100%	1	100%	50	100%	1	100%	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

2010/06/07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%	30	50.0%	1	50.0%	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%	30	50.0%	1	50.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	100	58.8%	4	50.0%
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%	10	5.9%	1	12.5%
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%	30	17.6%	1	12.5%
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%	50	76.9%	1	50.0%	30	17.6%	2	25.0%
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%	15	23.1%	1	50.0%	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%	60	100%	2	100%	0	0%	0	0%	65	100%	2	100%	170	100%	8	100%

	11 淡路信用金庫				12 大分みらい信用金庫				13 0				14 0				15 0			
	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%												
0.1%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	31.3%	1	16.7%	15	15.8%	1	25.0%												
0.3%超 0.4%以下	40	25.0%	2	33.3%	50	52.6%	2	50.0%												
0.4%超 0.5%以下	0	0.0%	0	0.0%	30	31.6%	1	25.0%												
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	30	18.8%	1	16.7%	0	0.0%	0	0.0%												
0.7%超 0.8%以下	20	12.5%	1	16.7%	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	20	12.5%	1	16.7%	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	160	100%	6	100%	95	100%	4	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)

【デフォルト債権】

デフォルト債権／延滞債権一覧

2010/06/07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, 郵便業	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	卸売業, 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	卸売業, 小売業	支払不履行	2008/9/22	2008/11/6	15,560,000	15,560,000	20,000,000
株式会社 岩手銀行	卸売業, 小売業	法的破綻等(手形交換所の取引停止処分)	2008/12/3	2009/1/21	40,008,000	37,067,879	60,000,000
株式会社 岩手銀行	運輸業, 郵便業	支払不履行	2008/12/22	2009/1/23	13,895,000	13,895,000	20,000,000
株式会社 岩手銀行	情報通信業	支払不履行	2008/12/22	2009/1/20	13,895,000	13,895,000	20,000,000
株式会社 岩手銀行	卸売業, 小売業	支払不履行	2009/5/20	2009/6/3	27,792,000	27,588,144	50,000,000
株式会社 岩手銀行	卸売業, 小売業	支払不履行	2010/1/20	2010/2/15	8,344,000	8,344,000	25,000,000
株式会社 岩手銀行	宿泊業, 飲食サービス業	支払不履行	2010/1/20	2010/2/5	6,680,000	6,680,000	20,000,000
株式会社 大分銀行	宿泊業, 飲食サービス業	条件緩和	2010/3/8	2010/6/2	2,244,000	379,909	10,000,000
株式会社 北日本銀行	卸売業, 小売業	支払不履行	2009/1/20	2009/3/2	33,344,000	33,344,000	50,000,000
千葉信用金庫	卸売業, 小売業	法的破綻等(民事再生手続開始)	2009/3/19	2009/5/14	15,839,000	15,839,000	30,000,000
千葉信用金庫	卸売業, 小売業	支払不履行	2010/2/22	2010/3/11	9,175,000	9,175,000	30,000,000
滋賀中央信用金庫	製造業	条件緩和	2008/6/30	2008/9/2	12,504,000	1,880,090	15,000,000
滋賀中央信用金庫	卸売業, 小売業	法的破綻等(民事再生手続開始)	2010/4/8	2010/5/12	8,360,000	8,360,000	50,000,000
大阪信用金庫	宿泊業, 飲食サービス業	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

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。

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

2010/06/07現在

取扱金融機関	業種	クレジットイベント事由等(注1)	事由発生日	デフォルト金額確定日(注2)	参照債務残高(注3)	デフォルト認定金額(注3)	当初元本
大阪信用金庫	卸売業, 小売業	法的破綻等(民事再生手続開始)	2008/11/6	2009/3/2	6,399,000	6,399,000	10,000,000
大阪信用金庫	卸売業, 小売業	条件緩和	2008/11/12	2008/12/3	23,336,000	3,390,720	30,000,000
大阪信用金庫	卸売業, 小売業	法的破綻等(破産手続開始)	2009/4/2	2009/6/5	15,839,000	15,839,000	30,000,000
大阪信用金庫	卸売業, 小売業	支払不履行	2009/8/20	2009/11/26	14,173,000	14,173,000	30,000,000
大阪信用金庫	卸売業, 小売業	支払不履行	2009/9/24	2009/12/2	8,900,000	8,900,000	20,000,000
大阪信用金庫	卸売業, 小売業	条件緩和	2010/2/25	2010/6/2	2,244,000	267,260	10,000,000
大阪信用金庫	卸売業, 小売業	条件緩和	2010/4/21	未確定	7,509,000	0	30,000,000
淡路信用金庫	卸売業, 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	卸売業, 小売業	支払不履行	2008/10/20	2008/11/17	22,503,000	22,503,000	30,000,000
淡路信用金庫	製造業	条件緩和	2008/11/14	2008/12/3	22,503,000	2,790,372	30,000,000
淡路信用金庫	生活関連サービス業, 娯楽業	支払不履行	2009/4/20	2009/6/5	11,675,000	11,675,000	20,000,000
淡路信用金庫	卸売業, 小売業	支払不履行	2009/9/24	2009/12/2	4,460,000	4,460,000	10,000,000
淡路信用金庫	卸売業, 小売業	支払不履行	2009/11/20	2010/2/26	7,790,000	7,790,000	20,000,000
大分みらい信用金庫	建設業	支払不履行	2009/2/20	2009/6/3	19,171,000	19,171,000	30,000,000
大分みらい信用金庫	不動産業, 物品賃貸業	支払不履行	2009/2/20	2009/6/3	19,171,000	19,171,000	30,000,000
大分みらい信用金庫	運輸業, 郵便業	法的破綻等(破産手続開始)	2009/12/2	2010/2/26	4,600,000	4,233,798	15,000,000
大分みらい信用金庫	卸売業, 小売業	支払不履行	2010/2/22	2010/5/7	6,125,000	6,125,000	20,000,000

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。