

「広域CLO(東京都・神奈川県・横浜市・川崎市合同)」発行後情報開示サマリー

(平成19年3月末時点)

1. 発行の概要

項目	優先受益権	メザニン受益権	ジュニアメザニン受益権
発行証券総額	¥1,085,000,000	¥182,000,000	¥140,000,000
固定配当率	0.49%	0.89%	—
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】 ・2006/1/15から3ヵ月ごと償還(休日翌営業日) ・平均年限(デフォルト、延滞が発生しない場合):2.125年	【当初どおり変更なし】 ・2006/1/15から3ヵ月ごと償還(休日翌営業日) ・平均年限(デフォルト、延滞が発生しない場合):2.125年	【当初どおり変更なし】 ・2006/1/15から3ヵ月ごと償還(休日翌営業日) ・平均年限(デフォルト、延滞が発生しない場合):2.125年
格付(維持、変更等)情報	Moody's 当初: Aaa 現在: Aaa	Moody's 当初: A2 現在: Aaa	Moody's 当初: Baa2 現在: Aaa

「広域CLO(東京都・神奈川県・横浜市・川崎市合同)」発行後情報開示サマリー

(平成19年3月末時点)

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 (オリジネーター・サービサー)	株式会社三菱東京UFJ銀行 株式会社東京都民銀行 株式会社八千代銀行
受託者	三菱UFJ信託銀行株式会社
アレンジャー	三菱UFJ証券株式会社、株式会社三菱東京UFJ銀行
セラー	中小企業金融公庫
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シニア劣後受益権(0.53億円)の設定 参加金融機関が保有するジュニア劣後受益権(約38.0%~約59.4%)の設定 流動性補完: 流動性補完の措置はない
相殺リスク	当初から全ての債務者に関して、債権譲渡に関する確定日付ある証書による異議を留めない承諾を取得する他、金銭消費貸借契約において相殺禁止条項を加える等の手当がなされている。
劣後部分現存額	シニア劣後受益権: ¥13,250,000 ジュニア劣後受益権(合計): ¥1,150,000,000
劣後部分毀損額	シニア劣後受益権: - ジュニア劣後受益権(合計): -

「広域CLO(東京都・神奈川県・横浜市・川崎市合同)」発行後情報開示サマリー
(平成19年3月末時点)

3. 裏付資産の属性、性質

項目	債券発行時点(平成16年9月)	平成19年3月末時点
債権残高	¥2,610,000,000	¥627,500,000
元本残高率	100.00%	24.04%
延滞率(注1)	0.00%	0.00%
デフォルト率(注2)	0.00%	0.00%
累積デフォルト率(注3)	0.00%	0.00%
債務者数	58社	56社
一債務者あたり平均貸出額	¥45,000,000	¥11,205,357
加重平均残存期間(WAM)	25.50ヶ月	1.13ヶ月

債権残高及び債務者数については、現状有姿交付及び期限前弁済を控除したものである。

(注1)延滞率:報告期間中の延滞発生金額/ 期初債権元本残高(%)

(注2)デフォルト率:期中発生デフォルト債権額(元本)/期初債権元本残高(%)

(注3)累積デフォルト率:累積デフォルト債権額(元本)/債権発行額(%)