

第2回地域金融機関CLO発行要項

以下は、「第2回地域金融機関CLO」に係るCLOの内容です。

発行金額 (格付:R&I/Moody's)	優先受益権	17,600,000,000円 (AAA/ Aaa)
	A ⁺ 受益権	310,000,000円 (AA/ A1)
	シニア劣後受益権	1,018,000,000円 (中小公庫保有)
	ジュニア劣後受益権	1,581,000,000円 (参加金融機関保有)
予定配当率	優先受益権	0.53%
	A ⁺ 受益権	0.65%
受益権発行日	平成17年12月22日	
予定最終償還日 (法定最終償還日)	平成21年1月15日(平成22年1月15日)	
信託配当支払日	平成18年4月17日を第1回とし、以後、毎年1月、4月、7月、10月の各15日、最終回は平成21年1月15日(当該期日が営業日でない場合は、その翌営業日)	
償還方法	平成18年4月17日を第1回とし、以後、毎年1月、4月、7月、10月の各15日、最終回は平成21年1月15日(当該期日が営業日でない場合は、その翌営業日) なお、各受益権の割合に応じたプロラタ償還	
信託債権の概要	840件(832社) / 総額20,509百万円 / 無担保・第三者保証なし デフォルト確率(単純平均) CRD(モジュール)0.58% / RDB(SME)0.69% / リスクカク(v3.1)0.32%	
参加金融機関 (オリジネーター/サービサー)	みちのく銀行、荘内銀行、岩手銀行、東京都民銀行、大分銀行、北日本銀行、東日本銀行、神奈川銀行、富山第一銀行、びわこ銀行、徳島銀行、愛媛銀行、熊本ファミリー銀行、豊和銀行、宮崎太陽銀行、函館信用金庫、朝日信用金庫、東京東信用金庫、多摩中央信用金庫、富山信用金庫、碧海信用金庫、蒲郡信用金庫、滋賀中央信用金庫、京都信用金庫、大阪東信用金庫、神戸信用金庫、尼崎信用金庫、福岡ひびき信用金庫、大分みらい信用金庫、鹿児島相互信用金庫、長野県信用組合(15銀行、15信用金庫、1信用組合。金融機関コード順) 大分県CLO参加金融機関	
委託者/セラー	中小企業金融公庫	
受託者	みずほ信託銀行	
信託受益権販売業者	大和証券SMBC	