

【新規格付け】地域金融機関平成19年3月CLO

信託受益権 優先受益権：AAA
メザニン受益権：AAA

格付投資情報センター（R&I）は上記の格付けを公表しました。

【案件の概要】

本件は、中小企業金融公庫による中小企業向け貸付債権の買取型証券化案件である。平成19年3月CLOの参加金融機関が募集した中小企業向け貸付債権を裏付け資産とする優先受益権、メザニン受益権に格付けを付与した。本件の予備格付けは2月16日に公表している。諸条件が確定したことに伴い、予備格付けを本格付けに切り替えた。

【格付け対象】

信託の名称	地域金融機関平成19年3月CLO
金額	優先受益権 4300百万円、メザニン受益権 168百万円
委託者	中小企業金融公庫
参加金融機関	福島銀行、愛媛銀行、熊本ファミリー銀行、帯広信用金庫、東奥信用金庫、新潟信用金庫、上田信用金庫、諏訪信用金庫、富山信用金庫、豊橋信用金庫、徳島信用金庫、高松信用金庫、茨城県信用組合、大東京信用組合、第一勸業信用組合、近畿産業信用組合
受託者	みずほ信託銀行
信託受益権販売業者	野村証券
裏付け資産	平成19年3月CLOの参加金融機関が募集した中小企業向け貸付債権
信託設定日	2007年3月23日
予定最終償還日	2012年4月16日
法定最終償還日	2013年4月15日
償還方法	コントロールド・アモチゼーション (優先受益権、メザニン受益権の割合に応じたプロラタ償還)
信用補完	優先劣後構造
格付け	個別信用補完
優先受益権	AAA メザニン受益権、シニア劣後受益権、ジュニア劣後受益権 (劣後比率約24.3%)
メザニン受益権	AAA シニア劣後受益権、ジュニア劣後受益権 (劣後比率約21.4%)
備考	格付けは、法定最終償還日までに優先受益権、メザニン受益権の元本が全額支払われ、期日通りに配当される可能性を評価したものである。