

「地域金融機関CLO シンセティック型(合同会社たんぼぼ2008)」発行後情報開示サマリー

(平成21年6月8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	¥25,400,000,000	¥800,000,000
利率(注1)	Tibor+0.65%	非公表
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20年6月20日とし、毎年3月、6月、9月及び12月に順次償還(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) : 1.56年	【当初どおり変更なし】 ・初回を平成20年6月20日とし、毎年3月、6月、9月及び12月に順次償還(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) : 1.56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: A1 A 現在: A1 A

(注1)3か月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)	みちのく銀行、東北銀行、広島銀行、阿波銀行、静岡中央銀行、中京銀行、トマト銀行、仙南信用金庫、飯能信用金庫、朝日信用金庫、亀有信用金庫、足立成和信用金庫、西京信用金庫、西武信用金庫、長野信用金庫、金沢信用金庫、桑名信用金庫、大阪信用金庫、※熊本第一信用金庫、※熊本中央信用金庫、茨城県信用組合、長野県信用組合 (金融機関コード順、合計22金融機関、※は「平成19年度熊本県CLO」参加金融機関)
社債管理者	みずほコーポレート銀行株式会社
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17.71億円)の設定 参加金融機関毎に設定する免責金額(約3.0%~約19.4%)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) ¥1,771,000,000(注2) 免責金額(合計) ¥1,547,000,000(注3)
うち劣後部分毀損額	劣後社債(合計) ¥162,584,462(注4) 免責金額(合計) ¥526,275,635(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額

(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ポートフォリオ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20年3月)	平成21年6月8日時点
参照債務残高	¥29,518,000,000	¥17,345,788,000
参照債務残高率	100.00%	58.76%
クレジットイベント発生率(注1)	0.00%	1.78%
累積クレジットイベント発生率(注2)	0.00%	2.33%
参照債務	1193件	1150件
一参照債務あたり平均貸出額	¥24,742,665	¥15,083,293

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の、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(%)

「地域金融機関CLO シンセティック型(合同会社たんぼぼ2008)」発行後情報開示サマリー
(平成21年6月8日時点)

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 (20年3月)	現在 (21年6月8日)	2009.3.7~ 2009.6.8	累積	免責金額	シニア劣後 上限金額
みちのく銀行	¥475,000,000	¥265,964,000	¥0	¥8,615,000	¥46,000,000	
東北銀行	¥661,000,000	¥394,386,000	¥0	¥0	¥57,000,000	
広島銀行	¥3,371,000,000	¥1,996,193,000	¥94,455,000	¥94,455,000	¥172,000,000	
阿波銀行	¥839,000,000	¥482,344,000	¥33,344,000	¥33,344,000	¥70,000,000	
静岡中央銀行	¥2,207,000,000	¥1,343,308,000	¥0	¥9,446,000	¥88,000,000	
中京銀行	¥1,902,000,000	¥1,136,438,000	¥0	¥24,169,000	¥90,000,000	
トマト銀行	¥5,415,000,000	¥3,172,592,000	¥84,023,635	¥92,361,635	¥160,000,000	
仙南信用金庫	¥617,000,000	¥372,029,000	¥0	¥0	¥41,000,000	
飯能信用金庫	¥1,475,000,000	¥897,622,000	¥0	¥0	¥59,000,000	
朝日信用金庫	¥2,300,000,000	¥1,280,289,000	¥86,680,000	¥141,682,000	¥68,000,000	
亀有信用金庫	¥1,376,000,000	¥810,814,000	¥0	¥0	¥80,000,000	
足立成和信用金庫	¥775,000,000	¥411,104,000	¥23,336,000	¥115,005,000	¥52,000,000	
西京信用金庫	¥1,301,000,000	¥773,969,000	¥0	¥32,216,000	¥95,000,000	
西武信用金庫	¥465,000,000	¥284,274,000	¥0	¥0	¥90,000,000	
長野信用金庫	¥766,000,000	¥476,719,000	¥0	¥0	¥53,000,000	
金沢信用金庫	¥1,167,000,000	¥640,286,000	¥37,508,000	¥90,897,462	¥65,000,000	
桑名信用金庫	¥810,000,000	¥495,364,000	¥0	¥0	¥47,000,000	
大阪信用金庫	¥300,000,000	¥166,013,000	¥0	¥18,335,000	¥29,000,000	
熊本第一信用金庫	¥587,000,000	¥328,442,000	¥0	¥0	¥35,000,000	
熊本中央信用金庫	¥355,000,000	¥217,142,000	¥0	¥0	¥40,000,000	
茨城県信用組合	¥652,000,000	¥365,656,000	¥0	¥28,334,000	¥50,000,000	
長野県信用組合	¥1,702,000,000	¥1,034,840,000	¥0	¥0	¥60,000,000	
合計	¥29,518,000,000	¥17,345,788,000	¥359,346,635	¥688,860,097	¥1,547,000,000	¥3,318,000,000

(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(合同会社たんぼぼ2008)」発行後情報開示サマリー

(平成21年6月8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	累積ホートフォリオ デフォルト金額	免責金額	免責超過金額 合計※1
2008/3/14 ~ 2008/6/20	29,518,000,000	1,636,457,000	27,881,543,000	0	0	1,547,000,000	0
2008/6/21 ~ 2008/9/22	27,881,543,000	2,525,819,000	25,355,724,000	62,835,462	62,835,462	1,547,000,000	0
2008/9/23 ~ 2008/12/22	25,355,724,000	2,675,005,000	22,680,719,000	217,509,000	280,344,462	1,547,000,000	39,669,000
2008/12/23 ~ 2009/3/23	22,680,719,000	2,529,757,000	20,150,962,000	49,169,000	329,513,462	1,547,000,000	39,669,000
2009/3/24 ~ 2009/6/22	20,150,962,000	2,805,174,000	17,345,788,000	359,346,635	688,860,097	1,547,000,000	162,584,462
2009/6/23 ~ 2007/9/24	17,345,788,000					1,547,000,000	0
2007/9/25 ~ 2009/12/21						1,547,000,000	0
2009/12/22 ~ 2010/3/23						1,547,000,000	0
2010/3/24 ~ 2010/6/21						1,547,000,000	0
2010/6/22 ~ 2010/9/21						1,547,000,000	0
2010/9/22 ~ 2010/12/20						1,547,000,000	0
2010/12/21 ~ 2011/3/31						1,547,000,000	0
2011/4/1 ~ 2011/5/31						1,547,000,000	0

※1:免責超過金額合計=各ハイヤーの免責超過金額の合計

みちのく銀行

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
2008/3/14 ~ 2008/6/20	475,000,000	26,368,000	448,632,000	0	0	46,000,000	0
2008/6/21 ~ 2008/9/22	448,632,000	39,552,000	409,080,000	0	0	46,000,000	0
2008/9/23 ~ 2008/12/22	409,080,000	62,057,000	347,023,000	0	0	46,000,000	0
2008/12/23 ~ 2009/3/23	347,023,000	44,837,000	302,186,000	8,615,000	8,615,000	46,000,000	0
2009/3/24 ~ 2009/6/22	302,186,000	36,222,000	265,964,000	0	8,615,000	46,000,000	0
2009/6/23 ~ 2007/9/24	265,964,000					46,000,000	0
2007/9/25 ~ 2009/12/21						46,000,000	0
2009/12/22 ~ 2010/3/23						46,000,000	0
2010/3/24 ~ 2010/6/21						46,000,000	0
2010/6/22 ~ 2010/9/21						46,000,000	0
2010/9/22 ~ 2010/12/20						46,000,000	0
2010/12/21 ~ 2011/3/31						46,000,000	0
2011/4/1 ~ 2011/5/31						46,000,000	0

東北銀行

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
2008/3/14 ~ 2008/6/20	661,000,000	36,690,000	624,310,000	0	0	57,000,000	0
2008/6/21 ~ 2008/9/22	624,310,000	55,035,000	569,275,000	0	0	57,000,000	0
2008/9/23 ~ 2008/12/22	569,275,000	55,035,000	514,240,000	0	0	57,000,000	0
2008/12/23 ~ 2009/3/23	514,240,000	66,151,000	448,089,000	0	0	57,000,000	0
2009/3/24 ~ 2009/6/22	448,089,000	53,703,000	394,386,000	0	0	57,000,000	0
2009/6/23 ~ 2007/9/24	394,386,000					57,000,000	0
2007/9/25 ~ 2009/12/21						57,000,000	0
2009/12/22 ~ 2010/3/23						57,000,000	0
2010/3/24 ~ 2010/6/21						57,000,000	0
2010/6/22 ~ 2010/9/21						57,000,000	0
2010/9/22 ~ 2010/12/20						57,000,000	0
2010/12/21 ~ 2011/3/31						57,000,000	0
2011/4/1 ~ 2011/5/31						57,000,000	0

広島銀行

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
2008/3/14 ~ 2008/6/20	3,371,000,000	187,152,000	3,183,848,000	0	0	172,000,000	0
2008/6/21 ~ 2008/9/22	3,183,848,000	280,728,000	2,903,120,000	0	0	172,000,000	0
2008/9/23 ~ 2008/12/22	2,903,120,000	280,728,000	2,622,392,000	0	0	172,000,000	0
2008/12/23 ~ 2009/3/23	2,622,392,000	276,563,000	2,345,829,000	0	0	172,000,000	0
2009/3/24 ~ 2009/6/22	2,345,829,000	349,636,000	1,996,193,000	94,455,000	94,455,000	172,000,000	0
2009/6/23 ~ 2007/9/24	1,996,193,000					172,000,000	0
2007/9/25 ~ 2009/12/21						172,000,000	0
2009/12/22 ~ 2010/3/23						172,000,000	0
2010/3/24 ~ 2010/6/21						172,000,000	0
2010/6/22 ~ 2010/9/21						172,000,000	0
2010/9/22 ~ 2010/12/20						172,000,000	0
2010/12/21 ~ 2011/3/31						172,000,000	0
2011/4/1 ~ 2011/5/31						172,000,000	0

阿波銀行

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
2008/3/14 ~ 2008/6/20	839,000,000	46,584,000	792,416,000	0	0	70,000,000	0
2008/6/21 ~ 2008/9/22	792,416,000	69,876,000	722,540,000	0	0	70,000,000	0
2008/9/23 ~ 2008/12/22	722,540,000	69,876,000	652,664,000	0	0	70,000,000	0
2008/12/23 ~ 2009/3/23	652,664,000	69,876,000	582,788,000	0	0	70,000,000	0
2009/3/24 ~ 2009/6/22	582,788,000	100,444,000	482,344,000	33,344,000	33,344,000	70,000,000	0
2009/6/23 ~ 2007/9/24	482,344,000					70,000,000	0
2007/9/25 ~ 2009/12/21						70,000,000	0
2009/12/22 ~ 2010/3/23						70,000,000	0
2010/3/24 ~ 2010/6/21						70,000,000	0
2010/6/22 ~ 2010/9/21						70,000,000	0
2010/9/22 ~ 2010/12/20						70,000,000	0
2010/12/21 ~ 2011/3/31						70,000,000	0
2011/4/1 ~ 2011/5/31						70,000,000	0

「地域金融機関CLO シンセティック型(合同会社たんぼぼ2008)」発行後情報開示サマリー

(平成21年6月8日時点)

静岡中央銀行

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
2008/3/14 ~ 2008/6/20	2,207,000,000	122,510,000	2,084,490,000	0	0	88,000,000	0
2008/6/21 ~ 2008/9/22	2,084,490,000	192,380,000	1,892,110,000	9,446,000	9,446,000	88,000,000	0
2008/9/23 ~ 2008/12/22	1,892,110,000	182,934,000	1,709,176,000	0	9,446,000	88,000,000	0
2008/12/23 ~ 2009/3/23	1,709,176,000	182,934,000	1,526,242,000	0	9,446,000	88,000,000	0
2009/3/24 ~ 2009/6/22	1,526,242,000	182,934,000	1,343,308,000	0	9,446,000	88,000,000	0
2009/6/23 ~ 2007/9/24	1,343,308,000					88,000,000	
2007/9/25 ~ 2009/12/21						88,000,000	
2009/12/22 ~ 2010/3/23						88,000,000	
2010/3/24 ~ 2010/6/21						88,000,000	
2010/6/22 ~ 2010/9/21						88,000,000	
2010/9/22 ~ 2010/12/20						88,000,000	
2010/12/21 ~ 2011/3/31						88,000,000	
2011/4/1 ~ 2011/5/31						88,000,000	

中京銀行

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
2008/3/14 ~ 2008/6/20	1,902,000,000	105,594,000	1,796,406,000	0	0	90,000,000	0
2008/6/21 ~ 2008/9/22	1,796,406,000	158,391,000	1,638,015,000	0	0	90,000,000	0
2008/9/23 ~ 2008/12/22	1,638,015,000	197,287,000	1,440,728,000	24,169,000	24,169,000	90,000,000	0
2008/12/23 ~ 2009/3/23	1,440,728,000	154,227,000	1,286,501,000	0	24,169,000	90,000,000	0
2009/3/24 ~ 2009/6/22	1,286,501,000	150,063,000	1,136,438,000	0	24,169,000	90,000,000	0
2009/6/23 ~ 2007/9/24	1,136,438,000					90,000,000	
2007/9/25 ~ 2009/12/21						90,000,000	
2009/12/22 ~ 2010/3/23						90,000,000	
2010/3/24 ~ 2010/6/21						90,000,000	
2010/6/22 ~ 2010/9/21						90,000,000	
2010/9/22 ~ 2010/12/20						90,000,000	
2010/12/21 ~ 2011/3/31						90,000,000	
2011/4/1 ~ 2011/5/31						90,000,000	

トマト銀行

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
2008/3/14 ~ 2008/6/20	5,415,000,000	300,530,000	5,114,470,000	0	0	160,000,000	0
2008/6/21 ~ 2008/9/22	5,114,470,000	450,518,000	4,663,952,000	0	0	160,000,000	0
2008/9/23 ~ 2008/12/22	4,663,952,000	448,576,000	4,215,376,000	0	0	160,000,000	0
2008/12/23 ~ 2009/3/23	4,215,376,000	447,752,000	3,767,624,000	8,338,000	8,338,000	160,000,000	0
2009/3/24 ~ 2009/6/22	3,767,624,000	595,032,000	3,172,592,000	84,023,635	92,361,635	160,000,000	0
2009/6/23 ~ 2007/9/24	3,172,592,000					160,000,000	
2007/9/25 ~ 2009/12/21						160,000,000	
2009/12/22 ~ 2010/3/23						160,000,000	
2010/3/24 ~ 2010/6/21						160,000,000	
2010/6/22 ~ 2010/9/21						160,000,000	
2010/9/22 ~ 2010/12/20						160,000,000	
2010/12/21 ~ 2011/3/31						160,000,000	
2011/4/1 ~ 2011/5/31						160,000,000	

仙南信用金庫

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
2008/3/14 ~ 2008/6/20	617,000,000	34,240,000	582,760,000	0	0	41,000,000	0
2008/6/21 ~ 2008/9/22	582,760,000	59,975,000	522,785,000	0	0	41,000,000	0
2008/9/23 ~ 2008/12/22	522,785,000	50,529,000	472,256,000	0	0	41,000,000	0
2008/12/23 ~ 2009/3/23	472,256,000	50,529,000	421,727,000	0	0	41,000,000	0
2009/3/24 ~ 2009/6/22	421,727,000	49,698,000	372,029,000	0	0	41,000,000	0
2009/6/23 ~ 2007/9/24	372,029,000					41,000,000	
2007/9/25 ~ 2009/12/21						41,000,000	
2009/12/22 ~ 2010/3/23						41,000,000	
2010/3/24 ~ 2010/6/21						41,000,000	
2010/6/22 ~ 2010/9/21						41,000,000	
2010/9/22 ~ 2010/12/20						41,000,000	
2010/12/21 ~ 2011/3/31						41,000,000	
2011/4/1 ~ 2011/5/31						41,000,000	

飯能信用金庫

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
2008/3/14 ~ 2008/6/20	1,475,000,000	81,846,000	1,393,154,000	0	0	59,000,000	0
2008/6/21 ~ 2008/9/22	1,393,154,000	131,384,000	1,261,770,000	0	0	59,000,000	0
2008/9/23 ~ 2008/12/22	1,261,770,000	121,938,000	1,139,832,000	0	0	59,000,000	0
2008/12/23 ~ 2009/3/23	1,139,832,000	121,938,000	1,017,894,000	0	0	59,000,000	0
2009/3/24 ~ 2009/6/22	1,017,894,000	120,272,000	897,622,000	0	0	59,000,000	0
2009/6/23 ~ 2007/9/24	897,622,000					59,000,000	
2007/9/25 ~ 2009/12/21						59,000,000	
2009/12/22 ~ 2010/3/23						59,000,000	
2010/3/24 ~ 2010/6/21						59,000,000	
2010/6/22 ~ 2010/9/21						59,000,000	
2010/9/22 ~ 2010/12/20						59,000,000	
2010/12/21 ~ 2011/3/31						59,000,000	
2011/4/1 ~ 2011/5/31						59,000,000	

「地域金融機関CLO シンセティック型(合同会社たんぼぼ2008)」発行後情報開示サマリー

(平成21年6月8日時点)

朝日信用金庫

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
2008/3/14 ~ 2008/6/20	2,300,000,000	127,692,000	2,172,308,000	0	0	68,000,000	0
2008/6/21 ~ 2008/9/22	2,172,308,000	188,206,000	1,984,102,000	0	0	68,000,000	0
2008/9/23 ~ 2008/12/22	1,984,102,000	241,265,000	1,742,837,000	55,002,000	55,002,000	68,000,000	0
2008/12/23 ~ 2009/3/23	1,742,837,000	202,656,000	1,540,181,000	0	55,002,000	68,000,000	0
2009/3/24 ~ 2009/6/22	1,540,181,000	259,892,000	1,280,289,000	86,680,000	141,682,000	68,000,000	73,682,000
2009/6/23 ~ 2007/9/24	1,280,289,000					68,000,000	
2007/9/25 ~ 2009/12/21						68,000,000	
2009/12/22 ~ 2010/3/23						68,000,000	
2010/3/24 ~ 2010/6/21						68,000,000	
2010/6/22 ~ 2010/9/21						68,000,000	
2010/9/22 ~ 2010/12/20						68,000,000	
2010/12/21 ~ 2011/3/31						68,000,000	
2011/4/1 ~ 2011/5/31						68,000,000	

単有信用金庫

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
2008/3/14 ~ 2008/6/20	1,376,000,000	76,374,000	1,299,626,000	0	0	80,000,000	0
2008/6/21 ~ 2008/9/22	1,299,626,000	114,561,000	1,185,065,000	0	0	80,000,000	0
2008/9/23 ~ 2008/12/22	1,185,065,000	114,561,000	1,070,504,000	0	0	80,000,000	0
2008/12/23 ~ 2009/3/23	1,070,504,000	113,173,000	957,331,000	0	0	80,000,000	0
2009/3/24 ~ 2009/6/22	957,331,000	146,517,000	810,814,000	0	0	80,000,000	0
2009/6/23 ~ 2007/9/24	810,814,000					80,000,000	
2007/9/25 ~ 2009/12/21						80,000,000	
2009/12/22 ~ 2010/3/23						80,000,000	
2010/3/24 ~ 2010/6/21						80,000,000	
2010/6/22 ~ 2010/9/21						80,000,000	
2010/9/22 ~ 2010/12/20						80,000,000	
2010/12/21 ~ 2011/3/31						80,000,000	
2011/4/1 ~ 2011/5/31						80,000,000	

足立成和信用金庫

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
2008/3/14 ~ 2008/6/20	775,000,000	43,014,000	731,986,000	0	0	52,000,000	0
2008/6/21 ~ 2008/9/22	731,986,000	56,190,000	675,796,000	0	0	52,000,000	0
2008/9/23 ~ 2008/12/22	675,796,000	139,528,000	536,268,000	91,669,000	91,669,000	52,000,000	39,669,000
2008/12/23 ~ 2009/3/23	536,268,000	56,468,000	479,800,000	0	91,669,000	52,000,000	39,669,000
2009/3/24 ~ 2009/6/22	479,800,000	68,696,000	411,104,000	23,336,000	115,005,000	52,000,000	63,005,000
2009/6/23 ~ 2007/9/24	411,104,000					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 ~ 2010/9/21						52,000,000	
2010/9/22 ~ 2010/12/20						52,000,000	
2010/12/21 ~ 2011/3/31						52,000,000	
2011/4/1 ~ 2011/5/31						52,000,000	

西京信用金庫

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
2008/3/14 ~ 2008/6/20	1,301,000,000	72,234,000	1,228,766,000	0	0	95,000,000	0
2008/6/21 ~ 2008/9/22	1,228,766,000	108,351,000	1,120,415,000	0	0	95,000,000	0
2008/9/23 ~ 2008/12/22	1,120,415,000	107,240,000	1,013,175,000	0	0	95,000,000	0
2008/12/23 ~ 2009/3/23	1,013,175,000	137,241,000	875,934,000	32,216,000	32,216,000	95,000,000	0
2009/3/24 ~ 2009/6/22	875,934,000	101,965,000	773,969,000	0	32,216,000	95,000,000	0
2009/6/23 ~ 2007/9/24	773,969,000					95,000,000	
2007/9/25 ~ 2009/12/21						95,000,000	
2009/12/22 ~ 2010/3/23						95,000,000	
2010/3/24 ~ 2010/6/21						95,000,000	
2010/6/22 ~ 2010/9/21						95,000,000	
2010/9/22 ~ 2010/12/20						95,000,000	
2010/12/21 ~ 2011/3/31						95,000,000	
2011/4/1 ~ 2011/5/31						95,000,000	

西武信用金庫

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
2008/3/14 ~ 2008/6/20	465,000,000	25,818,000	439,182,000	0	0	90,000,000	0
2008/6/21 ~ 2008/9/22	439,182,000	38,727,000	400,455,000	0	0	90,000,000	0
2008/9/23 ~ 2008/12/22	400,455,000	38,727,000	361,728,000	0	0	90,000,000	0
2008/12/23 ~ 2009/3/23	361,728,000	38,727,000	323,001,000	0	0	90,000,000	0
2009/3/24 ~ 2009/6/22	323,001,000	38,727,000	284,274,000	0	0	90,000,000	0
2009/6/23 ~ 2007/9/24	284,274,000					90,000,000	
2007/9/25 ~ 2009/12/21						90,000,000	
2009/12/22 ~ 2010/3/23						90,000,000	
2010/3/24 ~ 2010/6/21						90,000,000	
2010/6/22 ~ 2010/9/21						90,000,000	
2010/9/22 ~ 2010/12/20						90,000,000	
2010/12/21 ~ 2011/3/31						90,000,000	
2011/4/1 ~ 2011/5/31						90,000,000	

「地域金融機関CLO シンセティック型(合同会社たんぼぼ2008)」発行後情報開示サマリー

(平成21年6月8日時点)

長野信用金庫

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
2008/3/14 ~ 2008/6/20	766,000,000	42,516,000	723,484,000	0	0	53,000,000	0
2008/6/21 ~ 2008/9/22	723,484,000	63,774,000	659,710,000	0	0	53,000,000	0
2008/9/23 ~ 2008/12/22	659,710,000	63,774,000	595,936,000	0	0	53,000,000	0
2008/12/23 ~ 2009/3/23	595,936,000	63,774,000	532,162,000	0	0	53,000,000	0
2009/3/24 ~ 2009/6/22	532,162,000	55,443,000	476,719,000	0	0	53,000,000	0
2009/6/23 ~ 2007/9/24	476,719,000					53,000,000	
2007/9/25 ~ 2009/12/21						53,000,000	
2009/12/22 ~ 2010/3/23						53,000,000	
2010/3/24 ~ 2010/6/21						53,000,000	
2010/6/22 ~ 2010/9/21						53,000,000	
2010/9/22 ~ 2010/12/20						53,000,000	
2010/12/21 ~ 2011/3/31						53,000,000	
2011/4/1 ~ 2011/5/31						53,000,000	

金沢信用金庫

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
2008/3/14 ~ 2008/6/20	1,167,000,000	62,821,000	1,104,179,000	0	0	65,000,000	0
2008/6/21 ~ 2008/9/22	1,104,179,000	146,454,000	957,725,000	53,389,462	53,389,462	65,000,000	0
2008/9/23 ~ 2008/12/22	957,725,000	92,565,000	865,160,000	0	53,389,462	65,000,000	0
2008/12/23 ~ 2009/3/23	865,160,000	89,789,000	775,371,000	0	53,389,462	65,000,000	0
2009/3/24 ~ 2009/6/22	775,371,000	135,085,000	640,286,000	37,508,000	90,897,462	65,000,000	25,897,462
2009/6/23 ~ 2007/9/24	640,286,000					65,000,000	
2007/9/25 ~ 2009/12/21						65,000,000	
2009/12/22 ~ 2010/3/23						65,000,000	
2010/3/24 ~ 2010/6/21						65,000,000	
2010/6/22 ~ 2010/9/21						65,000,000	
2010/9/22 ~ 2010/12/20						65,000,000	
2010/12/21 ~ 2011/3/31						65,000,000	
2011/4/1 ~ 2011/5/31						65,000,000	

桑名信用金庫

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
2008/3/14 ~ 2008/6/20	810,000,000	44,948,000	765,052,000	0	0	47,000,000	0
2008/6/21 ~ 2008/9/22	765,052,000	67,422,000	697,630,000	0	0	47,000,000	0
2008/9/23 ~ 2008/12/22	697,630,000	67,422,000	630,208,000	0	0	47,000,000	0
2008/12/23 ~ 2009/3/23	630,208,000	67,422,000	562,786,000	0	0	47,000,000	0
2009/3/24 ~ 2009/6/22	562,786,000	67,422,000	495,364,000	0	0	47,000,000	0
2009/6/23 ~ 2007/9/24	495,364,000					47,000,000	
2007/9/25 ~ 2009/12/21						47,000,000	
2009/12/22 ~ 2010/3/23						47,000,000	
2010/3/24 ~ 2010/6/21						47,000,000	
2010/6/22 ~ 2010/9/21						47,000,000	
2010/9/22 ~ 2010/12/20						47,000,000	
2010/12/21 ~ 2011/3/31						47,000,000	
2011/4/1 ~ 2011/5/31						47,000,000	

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
2008/3/14 ~ 2008/6/20	300,000,000	16,638,000	283,362,000	0	0	29,000,000	0
2008/6/21 ~ 2008/9/22	283,362,000	32,462,000	250,900,000	0	0	29,000,000	0
2008/9/23 ~ 2008/12/22	250,900,000	40,796,000	210,104,000	18,335,000	18,335,000	29,000,000	0
2008/12/23 ~ 2009/3/23	210,104,000	22,461,000	187,643,000	0	18,335,000	29,000,000	0
2009/3/24 ~ 2009/6/22	187,643,000	21,630,000	166,013,000	0	18,335,000	29,000,000	0
2009/6/23 ~ 2007/9/24	166,013,000					29,000,000	
2007/9/25 ~ 2009/12/21						29,000,000	
2009/12/22 ~ 2010/3/23						29,000,000	
2010/3/24 ~ 2010/6/21						29,000,000	
2010/6/22 ~ 2010/9/21						29,000,000	
2010/9/22 ~ 2010/12/20						29,000,000	
2010/12/21 ~ 2011/3/31						29,000,000	
2011/4/1 ~ 2011/5/31						29,000,000	

熊本第一信用金庫

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
2008/3/14 ~ 2008/6/20	587,000,000	32,570,000	554,430,000	0	0	35,000,000	0
2008/6/21 ~ 2008/9/22	554,430,000	48,855,000	505,575,000	0	0	35,000,000	0
2008/9/23 ~ 2008/12/22	505,575,000	48,855,000	456,720,000	0	0	35,000,000	0
2008/12/23 ~ 2009/3/23	456,720,000	83,587,000	373,133,000	0	0	35,000,000	0
2009/3/24 ~ 2009/6/22	373,133,000	44,691,000	328,442,000	0	0	35,000,000	0
2009/6/23 ~ 2007/9/24	328,442,000					35,000,000	
2007/9/25 ~ 2009/12/21						35,000,000	
2009/12/22 ~ 2010/3/23						35,000,000	
2010/3/24 ~ 2010/6/21						35,000,000	
2010/6/22 ~ 2010/9/21						35,000,000	
2010/9/22 ~ 2010/12/20						35,000,000	
2010/12/21 ~ 2011/3/31						35,000,000	
2011/4/1 ~ 2011/5/31						35,000,000	

「地域金融機関CLO シンセティック型(合同会社たんぼぼ2008)」発行後情報開示サマリー

(平成21年6月8日時点)

熊本中央信用金庫

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
2008/3/14 ~ 2008/6/20	355,000,000	19,694,000	335,306,000	0	0	40,000,000	0
2008/6/21 ~ 2008/9/22	335,306,000	29,541,000	305,765,000	0	0	40,000,000	0
2008/9/23 ~ 2008/12/22	305,765,000	29,541,000	276,224,000	0	0	40,000,000	0
2008/12/23 ~ 2009/3/23	276,224,000	29,541,000	246,683,000	0	0	40,000,000	0
2009/3/24 ~ 2009/6/22	246,683,000	29,541,000	217,142,000	0	0	40,000,000	0
2009/6/23 ~ 2007/9/24	217,142,000					40,000,000	
2007/9/25 ~ 2009/12/21						40,000,000	
2009/12/22 ~ 2010/3/23						40,000,000	
2010/3/24 ~ 2010/6/21						40,000,000	
2010/6/22 ~ 2010/9/21						40,000,000	
2010/9/22 ~ 2010/12/20						40,000,000	
2010/12/21 ~ 2011/3/31						40,000,000	
2011/4/1 ~ 2011/5/31						40,000,000	

茨城県信用組合

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
2008/3/14 ~ 2008/6/20	652,000,000	36,190,000	615,810,000	0	0	50,000,000	0
2008/6/21 ~ 2008/9/22	615,810,000	51,786,000	564,024,000	0	0	50,000,000	0
2008/9/23 ~ 2008/12/22	564,024,000	80,120,000	483,904,000	28,334,000	28,334,000	50,000,000	0
2008/12/23 ~ 2009/3/23	483,904,000	68,460,000	415,444,000	0	28,334,000	50,000,000	0
2009/3/24 ~ 2009/6/22	415,444,000	49,788,000	365,656,000	0	28,334,000	50,000,000	0
2009/6/23 ~ 2007/9/24	365,656,000					50,000,000	
2007/9/25 ~ 2009/12/21						50,000,000	
2009/12/22 ~ 2010/3/23						50,000,000	
2010/3/24 ~ 2010/6/21						50,000,000	
2010/6/22 ~ 2010/9/21						50,000,000	
2010/9/22 ~ 2010/12/20						50,000,000	
2010/12/21 ~ 2011/3/31						50,000,000	
2011/4/1 ~ 2011/5/31						50,000,000	

長野県信用組合

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
2008/3/14 ~ 2008/6/20	1,702,000,000	94,434,000	1,607,566,000	0	0	60,000,000	0
2008/6/21 ~ 2008/9/22	1,607,566,000	141,651,000	1,465,915,000	0	0	60,000,000	0
2008/9/23 ~ 2008/12/22	1,465,915,000	141,651,000	1,324,264,000	0	0	60,000,000	0
2008/12/23 ~ 2009/3/23	1,324,264,000	141,651,000	1,182,613,000	0	0	60,000,000	0
2009/3/24 ~ 2009/6/22	1,182,613,000	147,773,000	1,034,840,000	0	0	60,000,000	0
2009/6/23 ~ 2007/9/24	1,034,840,000					60,000,000	
2007/9/25 ~ 2009/12/21						60,000,000	
2009/12/22 ~ 2010/3/23						60,000,000	
2010/3/24 ~ 2010/6/21						60,000,000	
2010/6/22 ~ 2010/9/21						60,000,000	
2010/9/22 ~ 2010/12/20						60,000,000	
2010/12/21 ~ 2011/3/31						60,000,000	
2011/4/1 ~ 2011/5/31						60,000,000	

※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(合同会社たんぼ2008)

業種分布

2009/06/08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	315	34.8%	7	29.2%
電気・ガス・熱供給・水道業	0	0.0%	0	0.0%
情報通信業	30	3.3%	1	4.2%
運輸業	10	1.1%	1	4.2%
卸売・小売業	310	34.3%	10	41.7%
不動産業	100	11.0%	1	4.2%
飲食店、宿泊業	40	4.4%	1	4.2%
教育、学習支援業	0	0.0%	0	0.0%
サービス業(他に分類されないもの)	100	11.0%	3	12.5%
総計	905	100%	24	100%

	1				2				3				4				5			
	株式会社 みちのく銀行				株式会社 東北銀行				株式会社 広島銀行				株式会社 阿波銀行				株式会社 静岡中央銀行			
	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%	140	100.0%	2	100.0%	50	100.0%	1	100.0%	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	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	100.0%	1	100.0%
卸売・小売業	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	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	10	100%	1	100%	0	0%	0	0%	140	100%	2	100%	50	100%	1	100%	10	100%	1	100%

	6				7				8				9				10			
	株式会社 中京銀行				株式会社 トマト銀行				仙南信用金庫				飯能信用金庫				朝日信用金庫			
	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%	30	16.7%	1	16.7%
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%	30	16.7%	1	16.7%
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	30	100.0%	1	100.0%	100	62.5%	2	50.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	120	66.7%	4	66.7%
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%	60	37.5%	2	50.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
総計	30	100%	1	100%	160	0%	4	100%	0	0%	0	0%	0	0%	0	0%	180	100%	6	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(合同会社たんぼぼ2008)

業種分布

2009/06/08現在

(単位:百万円)

	11 亀有信用金庫				12 足立成和信用金庫				13 西京信用金庫				14 西武信用金庫				15 長野信用金庫			
	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%	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	0	0.0%	0	0.0%	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%	30	23.1%	1	50.0%	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%	100	76.9%	1	50.0%	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%	40	100.0%	1	100.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
総計	0	0%	0	0%	130	100%	2	100%	40	100%	1	100%	0	0%	0	0%	0	0%	0	0%

	16 金沢信用金庫				17 桑名信用金庫				18 大阪信用金庫				19 熊本第一信用金庫				20 熊本中央信用金庫			
	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	65	61.9%	2	66.7%	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	0	0.0%	0	0.0%	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%	20	100.0%	1	100.0%	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	40	38.1%	1	33.3%	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%
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	105	100%	3	100%	0	0%	0	0%	20	100%	1	100%	0	0%	0	0%	0	0%	0	0%

	21 茨城県信用組合				22 長野県信用組合			
	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	30	100.0%	1	100.0%	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	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%
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	30	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(合同会社たんぼ2008)

貸付額分布

2009/06/08現在

(単位:百万円)

合計				
	金額	比率	件数	比率
10百万円以下	30	3.3%	3	12.5%
10百万円超 20百万円以下	35	3.9%	2	8.3%
20百万円超 30百万円以下	270	29.8%	9	37.5%
30百万円超 40百万円以下	120	13.3%	3	12.5%
40百万円超 50百万円以下	250	27.6%	5	20.8%
50百万円超 60百万円以下	0	0.0%	0	0.0%
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	200	22.1%	2	8.3%
100百万円超	0	0.0%	0	0.0%
総計	905	100%	24	100%

	1 株式会社 みちのく銀行				2 株式会社 東北銀行				3 株式会社 広島銀行				4 株式会社 阿波銀行				5 株式会社 静岡中央銀行			
	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	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	100.0%	1	100.0%
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%	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	28.6%	1	50.0%	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	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%	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%	100	71.4%	1	50.0%	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	10	100%	1	100%	0	0%	0	0%	140	100%	2	100%	50	100%	1	100%	10	100%	1	100%

	6 株式会社 中京銀行				7 株式会社 トマト銀行				8 仙南信用金庫				9 飯能信用金庫				10 朝日信用金庫			
	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%	10	6.3%	1	25.0%	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	0	0.0%	0	0.0%	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	30	100.0%	1	100.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	180	100.0%	6	100.0%
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%	150	93.8%	3	75.0%	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	30	100%	1	100%	160	100%	4	100%	0	0%	0	0%	0	0%	0	0%	180	100%	6	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(合同会社たんぼぼ2008)

貸付額分布

2009/06/08現在

(単位:百万円)

	11 亀有信用金庫				12 足立成和信用金庫				13 西京信用金庫				14 西武信用金庫				15 長野信用金庫			
	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%	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%	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%	30	23.1%	1	50.0%	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%	40	100.0%	1	100.0%	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%	100	76.9%	1	50.0%	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%	130	100%	2	100%	40	100%	1	100%	0	0%	0	0%	0	0%	0	0%

	16 金沢信用金庫				17 桑名信用金庫				18 大阪信用金庫				19 熊本第一信用金庫				20 熊本中央信用金庫			
	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%	0	0.0%	0	0.0%
10百万円超 20百万円以下	15	14.3%	1	33.3%	0	0.0%	0	0.0%	20	100.0%	1	100.0%	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	40	38.1%	1	33.3%	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	47.6%	1	33.3%	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	105	100%	3	100%	0	0%	0	0%	20	100%	1	100%	0	0%	0	0%	0	0%	0	0%

	21 茨城県信用組合				22 長野県信用組合			
	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	30	100.0%	1	100.0%	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	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%
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	30	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(合同会社たんぼ2008)

2009/06/08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		10	1.1%	1	4.2%
0.1%超 0.2%以下		70	7.7%	2	8.3%
0.2%超 0.3%以下		70	7.7%	3	12.5%
0.3%超 0.4%以下		140	15.5%	4	16.7%
0.4%超 0.5%以下		110	12.2%	3	12.5%
0.5%超 0.6%以下		95	10.5%	3	12.5%
0.6%超 0.7%以下		0	0.0%	0	0.0%
0.7%超 0.8%以下		90	9.9%	2	8.3%
0.8%超 0.9%以下		30	3.3%	1	4.2%
0.9%超 1.0%以下		100	11.0%	1	4.2%
1.0%超 1.1%以下		0	0.0%	0	0.0%
1.1%超 1.2%以下		100	11.0%	1	4.2%
1.2%超 1.3%以下		90	9.9%	3	12.5%
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		905	100%	24	100%

		1 株式会社 みちのく銀行				2 株式会社 東北銀行				3 株式会社 広島銀行				4 株式会社 阿波銀行				5 株式会社 静岡中央銀行			
		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		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	100.0%	1	100.0%
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%	50	100.0%	1	100.0%	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%	40	28.6%	1	50.0%	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%	100	71.4%	1	50.0%	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		10	100%	1	100%	0	0%	0	0%	140	100%	2	100%	50	100%	1	100%	10	100%	1	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(合同会社たんぼ2008)

CRDモデル3 累積1年デフォルト確率分布

2009/06/08現在

		6				7				8				9				10 (単位:百万円)			
		株式会社 中京銀行				株式会社 トマト銀行				仙南信用金庫				飯能信用金庫				朝日信用金庫			
		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%	10	6.3%	1	25.0%	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%	50	31.3%	1	25.0%	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		30	100.0%	1	100.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	60	33.3%	2	33.3%
0.4%超 0.5%以下		0	0.0%	0	0.0%	50	31.3%	1	25.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	60	33.3%	2	33.3%
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	16.7%	1	16.7%
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%	50	31.3%	1	25.0%	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	16.7%	1	16.7%
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		30	100%	1	100%	160	100%	4	100%	0	0%	0	0%	0	0%	0	0%	180	100%	6	100%

		11				12				13				14				15 (単位:百万円)			
		亀有信用金庫				足立成和信用金庫				西京信用金庫				西武信用金庫				長野信用金庫			
		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%	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%	100	76.9%	1	50.0%	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%	30	23.1%	1	50.0%	40	100.0%	1	100.0%	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%	130	100%	2	100%	40	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(合同会社たんぼ2008)

CRDモデル3 累積1年デフォルト確率分布

2009/06/08現在

	16				17				18				19				20			
	金沢信用金庫				桑名信用金庫				大阪信用金庫				熊本第一信用金庫				熊本中央信用金庫			
	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	40	38.1%	1	33.3%	0	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	47.6%	1	33.3%	0	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	15	14.3%	1	33.3%	0	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%	20	100.0%	1	100.0%	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	105	100%	3	100%	0	0%	0	0%	20	100%	1	100%	0	0%	0	0%	0	0%	0	0%

	21				22			
	茨城県信用組合				長野県信用組合			
	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	30	100.0%	1	100.0%	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	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	30	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(合同会社たんぼ2008)

2009/06/08現在

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)

		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		90	9.9%	3	12.5%
0.2%超 0.3%以下		30	3.3%	1	4.2%
0.3%超 0.4%以下		240	26.5%	6	25.0%
0.4%超 0.5%以下		70	7.7%	2	8.3%
0.5%超 0.6%以下		60	6.6%	2	8.3%
0.6%超 0.7%以下		50	5.5%	1	4.2%
0.7%超 0.8%以下		50	5.5%	1	4.2%
0.8%超 0.9%以下		30	3.3%	1	4.2%
0.9%超 1.0%以下		0	0.0%	0	0.0%
1.0%超 1.1%以下		110	12.2%	3	12.5%
1.1%超 1.2%以下		15	1.7%	1	4.2%
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		20	2.2%	1	4.2%
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		40	4.4%	1	4.2%
1.9%超 2.0%以下		0	0.0%	0	0.0%
2.0%超		100	11.0%	1	4.2%
総計		905	100%	24	100%

		1 株式会社 みちのく銀行				2 株式会社 東北銀行				3 株式会社 広島銀行				4 株式会社 阿波銀行				5 株式会社 静岡中央銀行			
		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		10	100.0%	1	100.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	10	100.0%	1	100.0%	0	0.0%
0.4%超 0.5%以下		0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	40	28.6%	1	50.0%	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%	50	100.0%	1	100.0%	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%	100	71.4%	1	50.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%
総計		10	100%	1	100%	0	0%	0	0%	140	100%	2	100%	50	100%	1	100%	10	100%	1	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(合同会社たんぼ2008)

RDB中小企業クレジットモデルデフォルト確率分布

2009/06/08現在

(単位:百万円)

	6 株式会社 中京銀行				7 株式会社 トマト銀行				8 仙南信用金庫				9 飯能信用金庫				10 朝日信用金庫			
	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%	60	37.5%	2	50.0%	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	16.7%	1	16.7%
0.3%超 0.4%以下	30	100.0%	1	100.0%	50	31.3%	1	25.0%	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%	30	16.7%	1	16.7%
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%	60	33.3%	2	33.3%
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%	50	31.3%	1	25.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	60	33.3%	2	33.3%
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	30	100%	1	100%	160	100%	4	100%	0	0%	0	0%	0	0%	0	0%	180	100%	6	100%

	11 亀有信用金庫				12 足立成和信用金庫				13 西京信用金庫				14 西武信用金庫				15 長野信用金庫			
	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%	100	76.9%	1	50.0%	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%	30	23.1%	1	50.0%	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%	40	100.0%	1	100.0%	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%	130	100%	2	100%	40	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(合同会社たんぼ2008)

RDB中小企業クレジットモデルデフォルト確率分布

2009/06/08現在

(単位:百万円)

	16 金沢信用金庫				17 桑名信用金庫				18 大阪信用金庫				19 熊本第一信用金庫				20 熊本中央信用金庫			
	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	40	38.1%	1	33.3%	0	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	50	47.6%	1	33.3%	0	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	15	14.3%	1	33.3%	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%	20	100.0%	1	100.0%	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	105	100%	3	100%	0	0%	0	0%	20	100%	1	100%	0	0%	0	0%	0	0%	0	0%

	21 茨城県信用組合				22 長野県信用組合			
	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	30	100.0%	1	100.0%	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	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	30	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(合同会社たんぼ2008)

2009/06/08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		80	8.8%	2	8.3%
0.1%超 0.2%以下		10	1.1%	1	4.2%
0.2%超 0.3%以下		95	10.5%	3	12.5%
0.3%超 0.4%以下		270	29.8%	8	33.3%
0.4%超 0.5%以下		50	5.5%	2	8.3%
0.5%超 0.6%以下		50	5.5%	2	8.3%
0.6%超 0.7%以下		70	7.7%	2	8.3%
0.7%超 0.8%以下		30	3.3%	1	4.2%
0.8%超 0.9%以下		150	16.6%	2	8.3%
0.9%超 1.0%以下		0	0.0%	0	0.0%
1.0%超 1.1%以下		100	11.0%	1	4.2%
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		0	0.0%	0	0.0%
総計		905	100%	24	100%

		1 株式会社 みちのく銀行				2 株式会社 東北銀行				3 株式会社 広島銀行				4 株式会社 阿波銀行				5 株式会社 静岡中央銀行			
		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%	10	100.0%	1	100.0%
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%	50	100.0%	1	100.0%	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		10	100.0%	1	100.0%	0	0.0%	0	0.0%	40	28.6%	1	50.0%	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%	100	71.4%	1	50.0%	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		10	100%	1	100%	0	0%	0	0%	140	100%	2	100%	50	100%	1	100%	10	100%	1	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(合同会社たんぼ2008)

リスクカルク日本版v3.1デフォルト確率分布

2009/06/08現在

(単位:百万円)

	6 株式会社 中京銀行				7 株式会社 トマト銀行				8 仙南信用金庫				9 飯能信用金庫				10 朝日信用金庫							
	金額		比率		件数		比率		金額		比率		件数		比率		金額		比率		件数		比率	
0.1%以下	0	0.0%	0	0.0%	50	31.3%	1	25.0%	0	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	0.0%	0	0.0%
0.2%超 0.3%以下	30	100.0%	1	100.0%	50	31.3%	1	25.0%	0	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%	10	6.3%	1	25.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	90	50.0%	3	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%	0	0.0%	30	16.7%	1	16.7%		
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	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%	30	16.7%	1	16.7%		
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%	30	16.7%	1	16.7%		
0.8%超 0.9%以下	0	0.0%	0	0.0%	50	31.3%	1	25.0%	0	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%	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%	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%	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%	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%	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%	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%	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%	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%	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%	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%	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%	0	0.0%	0	0.0%
総計	30	100%	1	100%	160	100%	4	100%	0	0%	0	0%	0	0%	0	0%	0	0%	180	100%	6	100%		

	11 亀有信用金庫				12 足立成和信用金庫				13 西京信用金庫				14 西武信用金庫				15 長野信用金庫							
	金額		比率		件数		比率		金額		比率		件数		比率		金額		比率		件数		比率	
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	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	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	0.0%	0	0.0%
0.3%超 0.4%以下	0	0.0%	0	0.0%	30	23.1%	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	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	0.0%	0	0.0%
0.6%超 0.7%以下	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	40	100.0%	1	100.0%	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	0.0%	0	0.0%
0.8%超 0.9%以下	0	0.0%	0	0.0%	100	76.9%	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%
0.9%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%	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%	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%	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%	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%	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%	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%	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%	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%	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%	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%	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%	0	0.0%	0	0.0%
総計	0	0%	0	0%	130	100%	2	100%	40	100%	1	100%	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(合同会社たんぼ2008)

リスクカルク日本版v3.1デフォルト確率分布

2009/06/08現在

	16 金沢信用金庫				17 桑名信用金庫				18 大阪信用金庫				19 熊本第一信用金庫				20 熊本中央信用金庫			
	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	15	14.3%	1	33.3%	0	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	90	85.7%	2	66.7%	0	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%	20	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	0	0.0%	0	0.0%	0	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	105	100%	3	100%	0	0%	0	0%	20	100%	1	100%	0	0%	0	0%	0	0%	0	0%

	21 茨城県信用組合				22 長野県信用組合			
	金額	比率	件数	比率	金額	比率	件数	比率
0.1%以下	30	100.0%	1	100.0%	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	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	30	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(合同会社たんぼ2008)

【デフォルト債権】

デフォルト債権／延滞債権一覧

2009/06/08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 みちのく銀行	卸売・小売業	支払不履行	2008/11/20	2009/2/17	8,615,000	8,615,000	10,000,000
株式会社 広島銀行	製造業	延滞	2009/1/20	未確定	36,120,000	0	50,000,000
株式会社 広島銀行	サービス業(他に分類されないもの)	延滞	2009/1/20	未確定	72,230,000	0	100,000,000
株式会社 広島銀行	製造業	法的破綻等(破産手続開始)	2009/2/17	2009/6/3	27,779,000	27,779,000	40,000,000
株式会社 広島銀行	製造業	法的破綻等(民事再生手続開始)	2009/3/31	2009/6/3	66,676,000	66,676,000	100,000,000
株式会社 広島銀行	卸売・小売業	延滞	2009/4/20	未確定	63,899,000	0	100,000,000
株式会社 広島銀行	不動産業	延滞	2009/4/20	未確定	31,956,000	0	50,000,000
株式会社 阿波銀行	製造業	法的破綻等(民事再生手続開始)	2009/3/18	2009/5/14	33,344,000	33,344,000	50,000,000
株式会社 静岡中央銀行	運輸業	法的破綻等(手形交換所の取引停止処分)	2008/6/12	2008/8/13	9,446,000	9,446,000	10,000,000
株式会社 中京銀行	卸売・小売業	法的破綻等(民事再生手続開始)	2008/10/8	2008/11/25	24,169,000	24,169,000	30,000,000
株式会社 中京銀行	運輸業	延滞	2009/2/20	未確定	34,732,000	0	50,000,000
株式会社 トマト銀行	サービス業(他に分類されないもの)	支払不履行	2008/12/22	2009/3/2	8,338,000	8,338,000	10,000,000
株式会社 トマト銀行	サービス業(他に分類されないもの)	条件緩和	2008/12/30	2009/3/2	40,284,000	7,891,635	50,000,000
株式会社 トマト銀行	卸売・小売業	支払不履行	2009/2/20	2009/6/3	38,896,000	38,896,000	50,000,000
株式会社 トマト銀行	サービス業(他に分類されないもの)	延滞	2009/2/20	未確定	6,953,000	0	10,000,000
株式会社 トマト銀行	卸売・小売業	延滞	2009/3/20	未確定	33,344,000	0	50,000,000
株式会社 トマト銀行	卸売・小売業	延滞	2009/3/20	未確定	33,344,000	0	50,000,000

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(合同会社たんぼ2008)

【デフォルト債権】

デフォルト債権／延滞債権一覧

2009/06/08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 トマト銀行	卸売・小売業	支払不履行	2009/3/23	2009/6/3	37,508,000	37,236,000	50,000,000
株式会社 トマト銀行	サービス業(他に分類されないもの)	延滞	2009/4/20	未確定	6,399,000	0	10,000,000
株式会社 トマト銀行	サービス業(他に分類されないもの)	延滞	2009/4/20	未確定	31,956,000	0	50,000,000
仙南信用金庫	卸売・小売業	延滞	2009/2/20	未確定	6,953,000	0	10,000,000
飯能信用金庫	卸売・小売業	延滞	2009/3/20	未確定	20,004,000	0	30,000,000
朝日信用金庫	情報通信業	支払不履行	2008/8/20	2008/11/25	28,334,000	28,334,000	30,000,000
朝日信用金庫	卸売・小売業	支払不履行	2008/10/20	2008/11/25	26,668,000	26,668,000	30,000,000
朝日信用金庫	卸売・小売業	法的破綻等(破産手続開始)	2009/1/30	2009/4/20	20,837,000	20,837,000	30,000,000
朝日信用金庫	製造業	支払不履行	2009/2/20	2009/5/14	23,336,000	23,336,000	30,000,000
朝日信用金庫	卸売・小売業	法的破綻等(破産手続開始)	2009/3/11	2009/5/14	23,336,000	23,336,000	30,000,000
朝日信用金庫	情報通信業	延滞	2009/3/20	未確定	20,004,000	0	30,000,000
朝日信用金庫	卸売・小売業	法的破綻等(破産手続開始)	2009/4/8	2009/5/14	19,171,000	19,171,000	30,000,000
朝日信用金庫	卸売・小売業	延滞	2009/4/20	未確定	19,171,000	0	30,000,000
足立成和信用金庫	不動産業	支払不履行	2008/9/22	2008/10/29	91,669,000	91,669,000	100,000,000
足立成和信用金庫	製造業	延滞	2008/11/20	未確定	77,784,000	0	100,000,000
足立成和信用金庫	卸売・小売業	支払不履行	2009/2/20	2009/5/25	23,336,000	23,336,000	30,000,000
西京信用金庫	サービス業(他に分類されないもの)	支払不履行	2009/1/20	2009/3/2	32,223,000	32,216,000	40,000,000

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(合同会社たんぽぽ2008)

【デフォルト債権】

デフォルト債権／延滞債権一覧

2009/06/08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
西京信用金庫	情報通信業	延滞	2009/2/20	未確定	13,895,000	0	20,000,000
西京信用金庫	不動産業	延滞	2009/4/20	未確定	31,956,000	0	50,000,000
長野信用金庫	製造業	延滞	2009/2/20	未確定	69,453,000	0	100,000,000
金沢信用金庫	製造業	法的破綻等(民事再生手続開始)	2008/6/3	2008/9/2	15,000,000	14,500,462	15,000,000
金沢信用金庫	飲食店、宿泊業	支払不履行	2008/7/22	2008/9/2	38,889,000	38,889,000	40,000,000
金沢信用金庫	製造業	支払不履行	2009/3/23	2009/6/3	37,508,000	37,508,000	50,000,000
大阪信用金庫	卸売・小売業	法的破綻等(民事再生手続開始)	2008/8/5	2008/10/9	18,335,000	18,335,000	20,000,000
大阪信用金庫	卸売・小売業	延滞	2009/2/20	未確定	6,953,000	0	10,000,000
茨城県信用組合	製造業	支払不履行	2008/8/20	2008/11/25	28,334,000	28,334,000	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。