

「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9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                     | ¥25,400,000,000   | ¥800,000,000  |
| 利率(注1)                     | Tibor+0.65%   | 非公表   |
| 予定償還日<br>または<br>予定償還スケジュール | 【当初どおり変更なし】<br>・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)<br>・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】<br>・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)<br>・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<br>当初: Aaa AAA<br>現在: Aaa AAA   | Moody's R&I<br>当初: A1 A<br>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<br>(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<br>(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<br>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<br>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)<br>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) ¥302,423,532 (注4)<br>免責金額(合計) ¥666,699,324 (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9月7日時点     |
|--------------------|-----------------|-----------------|
| 参照債務残高             | ¥29,518,000,000 | ¥14,640,449,000 |
| 参照債務残高率            | 100.00%         | 49.60%          |
| クレジットイベント発生率(注1)   | 0.00%           | 1.62%           |
| 累積クレジットイベント発生率(注2) | 0.00%           | 3.28%           |
| 参照債務               | 1193件           | 1127件           |
| 一参照債務あたり平均貸出額      | ¥24,742,665     | ¥12,990,637     |

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9月7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<br>(20年3月)   | 現在<br>(21年9月7日) | 2009.6.9～<br>2009.9.7 | 累積           | 免責金額           | シニア劣後<br>上限金額  |
| みちのく銀行   | ¥475,000,000    | ¥203,338,000    | ¥0                    | ¥8,615,000   | ¥46,000,000    |                |
| 東北銀行     | ¥661,000,000    | ¥340,683,000    | ¥0                    | ¥0           | ¥57,000,000    |                |
| 広島銀行     | ¥3,371,000,000  | ¥1,729,889,000  | ¥0                    | ¥94,455,000  | ¥172,000,000   |                |
| 阿波銀行     | ¥839,000,000    | ¥416,632,000    | ¥0                    | ¥33,344,000  | ¥70,000,000    |                |
| 静岡中央銀行   | ¥2,207,000,000  | ¥1,160,374,000  | ¥0                    | ¥9,446,000   | ¥88,000,000    |                |
| 中京銀行     | ¥1,902,000,000  | ¥987,763,000    | ¥0                    | ¥24,169,000  | ¥90,000,000    |                |
| トマト銀行    | ¥5,415,000,000  | ¥2,651,153,000  | ¥105,597,000          | ¥197,958,635 | ¥160,000,000   |                |
| 仙南信用金庫   | ¥617,000,000    | ¥315,378,000    | ¥6,942,324            | ¥6,942,324   | ¥41,000,000    |                |
| 飯能信用金庫   | ¥1,475,000,000  | ¥744,977,000    | ¥19,992,000           | ¥19,992,000  | ¥59,000,000    |                |
| 朝日信用金庫   | ¥2,300,000,000  | ¥1,053,435,000  | ¥32,427,435           | ¥174,109,435 | ¥68,000,000    |                |
| 亀有信用金庫   | ¥1,376,000,000  | ¥680,675,000    | ¥0                    | ¥0           | ¥80,000,000    |                |
| 足立成和信用金庫 | ¥775,000,000    | ¥287,960,000    | ¥69,453,000           | ¥184,458,000 | ¥52,000,000    |                |
| 西京信用金庫   | ¥1,301,000,000  | ¥633,093,000    | ¥45,851,000           | ¥78,067,000  | ¥95,000,000    |                |
| 西武信用金庫   | ¥465,000,000    | ¥245,547,000    | ¥0                    | ¥0           | ¥90,000,000    |                |
| 長野信用金庫   | ¥766,000,000    | ¥421,553,000    | ¥0                    | ¥0           | ¥53,000,000    |                |
| 金沢信用金庫   | ¥1,167,000,000  | ¥547,842,000    | ¥0                    | ¥90,897,462  | ¥65,000,000    |                |
| 桑名信用金庫   | ¥810,000,000    | ¥422,651,000    | ¥0                    | ¥0           | ¥47,000,000    |                |
| 大阪信用金庫   | ¥300,000,000    | ¥137,430,000    | ¥0                    | ¥18,335,000  | ¥29,000,000    |                |
| 熊本第一信用金庫 | ¥587,000,000    | ¥278,460,000    | ¥0                    | ¥0           | ¥35,000,000    |                |
| 熊本中央信用金庫 | ¥355,000,000    | ¥177,019,000    | ¥0                    | ¥0           | ¥40,000,000    |                |
| 茨城県信用組合  | ¥652,000,000    | ¥310,577,000    | ¥0                    | ¥28,334,000  | ¥50,000,000    |                |
| 長野県信用組合  | ¥1,702,000,000  | ¥894,020,000    | ¥0                    | ¥0           | ¥60,000,000    |                |
| 合計       | ¥29,518,000,000 | ¥14,640,449,000 | ¥280,262,759          | ¥969,122,856 | ¥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9月7日時点)

全体

| プレミアム計算期間              | 参照債務残高<br>(開始日) | 参照債務<br>減少額   | 参照債務残高<br>(末日) | デフォルト金額     | 累積ホートフォリオ<br>デフォルト金額 | 免責金額          | 免責超過金額<br>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  | 2,547,123,000 | 20,133,596,000 | 49,169,000  | 329,513,462          | 1,547,000,000 | 39,669,000     |
| 2009/3/24 ~ 2009/6/22  | 20,133,596,000  | 2,815,336,000 | 17,318,260,000 | 359,346,635 | 688,860,097          | 1,547,000,000 | 162,584,462    |
| 2009/6/23 ~ 2007/9/24  | 17,318,260,000  | 2,677,811,000 | 14,640,449,000 | 280,262,759 | 969,122,856          | 1,547,000,000 | 302,423,532    |
| 2007/9/25 ~ 2009/12/21 | 14,640,449,000  |               |                |             |                      | 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=各バ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<br>(開始日) | 参照債務<br>減少額 | 参照債務残高<br>(末日) | デフォルト金額   | 累積ホートフォリオ<br>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     | 62,626,000  | 203,338,000    | 0         | 8,615,000            | 46,000,000 | 0        |
| 2007/9/25 ~ 2009/12/21 | 203,338,000     |             |                |           |                      | 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<br>(開始日) | 参照債務<br>減少額 | 参照債務残高<br>(末日) | デフォルト金額 | 累積ホートフォリオ<br>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     | 53,703,000  | 340,683,000    | 0       | 0                    | 57,000,000 | 0        |
| 2007/9/25 ~ 2009/12/21 | 340,683,000     |             |                |         |                      | 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<br>(開始日) | 参照債務<br>減少額 | 参照債務残高<br>(末日) | デフォルト金額    | 累積ホートフォリオ<br>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   | 266,304,000 | 1,729,889,000  | 0          | 94,455,000           | 172,000,000 | 0        |
| 2007/9/25 ~ 2009/12/21 | 1,729,889,000   |             |                |            |                      | 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<br>(開始日) | 参照債務<br>減少額 | 参照債務残高<br>(末日) | デフォルト金額    | 累積ホートフォリオ<br>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     | 65,712,000  | 416,632,000    | 0          | 33,344,000           | 70,000,000 | 0        |
| 2007/9/25 ~ 2009/12/21 | 416,632,000     |             |                |            |                      | 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9月7日時点)

静岡中央銀行

| プレミアム計算期間              | 参照債務残高<br>(開始日) | 参照債務<br>減少額 | 参照債務残高<br>(末日) | デフォルト金額   | 累積ホートフォリオ<br>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   | 182,934,000 | 1,160,374,000  | 0         | 9,446,000            | 88,000,000 | 0        |
| 2007/9/25 ~ 2009/12/21 | 1,160,374,000   |             |                |           |                      | 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<br>(開始日) | 参照債務<br>減少額 | 参照債務残高<br>(末日) | デフォルト金額    | 累積ホートフォリオ<br>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   | 148,675,000 | 987,763,000    | 0          | 24,169,000           | 90,000,000 | 0        |
| 2007/9/25 ~ 2009/12/21 | 987,763,000     |             |                |            |                      | 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<br>(開始日) | 参照債務<br>減少額 | 参照債務残高<br>(末日) | デフォルト金額     | 累積ホートフォリオ<br>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   | 521,439,000 | 2,651,153,000  | 105,597,000 | 197,958,635          | 160,000,000 | 37,958,635 |
| 2007/9/25 ~ 2009/12/21 | 2,651,153,000   |             |                |             |                      | 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<br>(開始日) | 参照債務<br>減少額 | 参照債務残高<br>(末日) | デフォルト金額   | 累積ホートフォリオ<br>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     | 56,651,000  | 315,378,000    | 6,942,324 | 6,942,324            | 41,000,000 | 0        |
| 2007/9/25 ~ 2009/12/21 | 315,378,000     |             |                |           |                      | 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<br>(開始日) | 参照債務<br>減少額 | 参照債務残高<br>(末日) | デフォルト金額    | 累積ホートフォリオ<br>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   | 139,304,000 | 1,000,528,000  | 0          | 0                    | 59,000,000 | 0        |
| 2009/3/24 ~ 2009/6/22  | 1,000,528,000   | 118,190,000 | 882,338,000    | 0          | 0                    | 59,000,000 | 0        |
| 2009/6/23 ~ 2007/9/24  | 882,338,000     | 137,361,000 | 744,977,000    | 19,992,000 | 19,992,000           | 59,000,000 | 0        |
| 2007/9/25 ~ 2009/12/21 | 744,977,000     |             |                |            |                      | 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 |          |

2008/12/23～2009/3/23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。

「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9月7日時点)

朝日信用金庫

| プレミアム計算期間              | 参照債務残高<br>(開始日) | 参照債務<br>減少額 | 参照債務残高<br>(末日) | デフォルト金額    | 累積ホートフォリオ<br>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 ~ 2009/9/24  | 1,280,289,000   | 226,854,000 | 1,053,435,000  | 32,427,435 | 174,109,435          | 68,000,000 | 106,109,435 |
| 2009/9/25 ~ 2009/12/21 | 1,053,435,000   |             |                |            |                      | 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<br>(開始日) | 参照債務<br>減少額 | 参照債務残高<br>(末日) | デフォルト金額 | 累積ホートフォリオ<br>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 ~ 2009/9/24  | 810,814,000     | 130,139,000 | 680,675,000    | 0       | 0                    | 80,000,000 | 0        |
| 2009/9/25 ~ 2009/12/21 | 680,675,000     |             |                |         |                      | 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<br>(開始日) | 参照債務<br>減少額 | 参照債務残高<br>(末日) | デフォルト金額    | 累積ホートフォリオ<br>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 ~ 2009/9/24  | 411,104,000     | 123,144,000 | 287,960,000    | 69,453,000 | 184,458,000          | 52,000,000 | 132,458,000 |
| 2009/9/25 ~ 2009/12/21 | 287,960,000     |             |                |            |                      | 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<br>(開始日) | 参照債務<br>減少額 | 参照債務残高<br>(末日) | デフォルト金額    | 累積ホートフォリオ<br>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 ~ 2009/9/24  | 773,969,000     | 140,876,000 | 633,093,000    | 45,851,000 | 78,067,000           | 95,000,000 | 0        |
| 2009/9/25 ~ 2009/12/21 | 633,093,000     |             |                |            |                      | 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<br>(開始日) | 参照債務<br>減少額 | 参照債務残高<br>(末日) | デフォルト金額 | 累積ホートフォリオ<br>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 ~ 2009/9/24  | 284,274,000     | 38,727,000  | 245,547,000    | 0       | 0                    | 90,000,000 | 0        |
| 2009/9/25 ~ 2009/12/21 | 245,547,000     |             |                |         |                      | 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9月7日時点)

長野信用金庫

| プレミアム計算期間              | 参照債務残高<br>(開始日) | 参照債務<br>減少額 | 参照債務残高<br>(末日) | デフォルト金額 | 累積ポートフォリオ<br>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     | 55,166,000  | 421,553,000    | 0       | 0                    | 53,000,000 | 0        |
| 2007/9/25 ~ 2009/12/21 | 421,553,000     |             |                |         |                      | 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<br>(開始日) | 参照債務<br>減少額 | 参照債務残高<br>(末日) | デフォルト金額    | 累積ポートフォリオ<br>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     | 92,444,000  | 547,842,000    | 0          | 90,897,462           | 65,000,000 | 25,897,462 |
| 2007/9/25 ~ 2009/12/21 | 547,842,000     |             |                |            |                      | 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<br>(開始日) | 参照債務<br>減少額 | 参照債務残高<br>(末日) | デフォルト金額 | 累積ポートフォリオ<br>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     | 72,713,000  | 422,651,000    | 0       | 0                    | 47,000,000 | 0        |
| 2007/9/25 ~ 2009/12/21 | 422,651,000     |             |                |         |                      | 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<br>(開始日) | 参照債務<br>減少額 | 参照債務残高<br>(末日) | デフォルト金額    | 累積ポートフォリオ<br>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     | 27,752,000  | 159,891,000    | 0          | 18,335,000           | 29,000,000 | 0        |
| 2009/6/23 ~ 2007/9/24  | 159,891,000     | 22,461,000  | 137,430,000    | 0          | 18,335,000           | 29,000,000 | 0        |
| 2007/9/25 ~ 2009/12/21 | 137,430,000     |             |                |            |                      | 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 |          |

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。

熊本第一信用金庫

| プレミアム計算期間              | 参照債務残高<br>(開始日) | 参照債務<br>減少額 | 参照債務残高<br>(末日) | デフォルト金額 | 累積ポートフォリオ<br>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     | 50,813,000  | 322,320,000    | 0       | 0                    | 35,000,000 | 0        |
| 2009/6/23 ~ 2007/9/24  | 322,320,000     | 43,860,000  | 278,460,000    | 0       | 0                    | 35,000,000 | 0        |
| 2007/9/25 ~ 2009/12/21 | 278,460,000     |             |                |         |                      | 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 |          |

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。

「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9月7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<br>(開始日) | 参照債務<br>減少額 | 参照債務残高<br>(末日) | デフォルト金額 | 累積ポートフォリオ<br>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     | 40,123,000  | 177,019,000    | 0       | 0                    | 40,000,000 | 0        |
| 2007/9/25 ~ 2009/12/21 | 177,019,000     |             |                |         |                      | 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<br>(開始日) | 参照債務<br>減少額 | 参照債務残高<br>(末日) | デフォルト金額    | 累積ポートフォリオ<br>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     | 55,079,000  | 310,577,000    | 0          | 28,334,000           | 50,000,000 | 0        |
| 2007/9/25 ~ 2009/12/21 | 310,577,000     |             |                |            |                      | 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<br>(開始日) | 参照債務<br>減少額 | 参照債務残高<br>(末日) | デフォルト金額 | 累積ポートフォリオ<br>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   | 140,820,000 | 894,020,000    | 0       | 0                    | 60,000,000 | 0        |
| 2007/9/25 ~ 2009/12/21 | 894,020,000     |             |                |         |                      | 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(合同会社たんぽぽ2008)

業種分布

2009/09/07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               | 0    | 0.0%  | 0  | 0.0%  |
| 製造業               | 415  | 31.1% | 8  | 22.9% |
| 電気・ガス・熱供給・水道業     | 0    | 0.0%  | 0  | 0.0%  |
| 情報通信業             | 80   | 6.0%  | 3  | 8.6%  |
| 運輸業, 郵便業          | 10   | 0.7%  | 1  | 2.9%  |
| 卸売業, 小売業          | 480  | 36.0% | 15 | 42.9% |
| 金融業, 保険業          | 0    | 0.0%  | 0  | 0.0%  |
| 不動産業, 物品賃貸業       | 150  | 11.2% | 2  | 5.7%  |
| 学術研究, 専門・技術サービス業  | 60   | 4.5%  | 2  | 5.7%  |
| 宿泊業, 飲食サービス業      | 40   | 3.0%  | 1  | 2.9%  |
| 生活関連サービス業, 娯楽業    | 50   | 3.7%  | 1  | 2.9%  |
| 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) | 50   | 3.7%  | 2  | 5.7%  |
| 総計                | 1335 | 100%  | 35 | 100%  |

|                   | 1 株式会社 みのく銀行 |        |    |        | 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     |
| 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% | 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, 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%   | 10            | 100.0% | 1  | 100.0% |
| 卸売業, 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%   |
| 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%   | 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                | 10           | 100%   | 1  | 100%   | 0           | 0%   | 0  | 0%   | 140         | 100%   | 2  | 100%   | 50          | 100%   | 1  | 100%   | 10            | 100%   | 1  | 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(合同会社たんぽぽ2008)

業種分布

2009/09/07現在

(単位:百万円)

|                   | 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     | 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%   | 30  | 12.5% | 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%   | 60  | 25.0% | 2  | 25.0% |
| 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          | 30        | 100.0% | 1          | 100.0% | 200    | 62.5% | 4      | 50.0% | 10     | 100.0% | 1  | 100.0% | 30 | 100.0% | 1  | 100.0% | 150 | 62.5% | 5  | 62.5% |
| 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%   | 60     | 18.8% | 2      | 25.0% | 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%   | 0   | 0.0%  | 0  | 0.0%  |
| 生活関連サービス業, 娯楽業    | 0         | 0.0%   | 0          | 0.0%   | 50     | 15.6% | 1      | 12.5% | 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%   | 10     | 3.1%  | 1      | 12.5% | 0      | 0.0%   | 0  | 0.0%   | 0  | 0.0%   | 0  | 0.0%   | 0   | 0.0%  | 0  | 0.0%  |
| 総計                | 30        | 100%   | 1          | 100%   | 320    | 0%    | 8      | 100%  | 10     | 100%   | 1  | 100%   | 30 | 100%   | 1  | 100%   | 240 | 100%  | 8  | 100%  |

|                   | 11     |      |          |      | 12     |       |        |       | 13     |       |    |       | 14 |      |    |      | 15 |      |    |      |
|-------------------|--------|------|----------|------|--------|-------|--------|-------|--------|-------|----|-------|----|------|----|------|----|------|----|------|
|                   | 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   | 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% | 100    | 43.5% | 1      | 33.3% | 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%  | 20     | 18.2% | 1  | 33.3% | 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% | 30     | 13.0% | 1      | 33.3% | 0      | 0.0%  | 0  | 0.0%  | 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% | 100    | 43.5% | 1      | 33.3% | 50     | 45.5% | 1  | 33.3% | 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% | 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%  | 40     | 36.4% | 1  | 33.3% | 0  | 0.0% | 0  | 0.0% | 0  | 0.0% | 0  | 0.0% |
| 総計                | 0      | 0%   | 0        | 0%   | 230    | 100%  | 3      | 100%  | 110    | 100%  | 3  | 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(合同会社たんぼ2008)

業種分布

2009/09/07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   |
| 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               | 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, 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%  | 0         | 0.0% | 0  | 0.0% | 20        | 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      | 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% |
| 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                | 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   |
| 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%   | 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, 郵便業          | 0          | 0.0%   | 0  | 0.0%   | 0          | 0.0% | 0  | 0.0% |
| 卸売業, 小売業          | 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% |
| 不動産業, 物品賃貸業       | 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% |
| 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    | 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% |
| 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                | 30         | 100%   | 1  | 100%   | 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(合同会社たんぼ2008)

貸付額分布

2009/09/07現在

(単位:百万円)

| 合計              |      |       |    |       |
|-----------------|------|-------|----|-------|
|                 | 金額   | 比率    | 件数 | 比率    |
| 10百万円以下         | 50   | 3.7%  | 5  | 14.3% |
| 10百万円超 20百万円以下  | 55   | 4.1%  | 3  | 8.6%  |
| 20百万円超 30百万円以下  | 360  | 27.0% | 12 | 34.3% |
| 30百万円超 40百万円以下  | 120  | 9.0%  | 3  | 8.6%  |
| 40百万円超 50百万円以下  | 450  | 33.7% | 9  | 25.7% |
| 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 | 300  | 22.5% | 3  | 8.6%  |
| 100百万円超         | 0    | 0.0%  | 0  | 0.0%  |
| 総計              | 1335 | 100%  | 35 | 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%   | 20           | 6.3%  | 2  | 25.0% | 10       | 100.0% | 1  | 100.0% | 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%   | 30       | 100.0% | 1  | 100.0% | 240       | 100.0% | 8  | 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%   | 300          | 93.8% | 6  | 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%   | 320          | 100%  | 8  | 100%  | 10       | 100%   | 1  | 100%   | 30       | 100%   | 1  | 100%   | 240       | 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(合同会社たんぼ2008)

貸付額分布

2009/09/07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%  | 20        | 18.2% | 1  | 33.3% | 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          | 13.0% | 1  | 33.3% | 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        | 36.4% | 1  | 33.3% | 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        | 45.5% | 1  | 33.3% | 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% | 200         | 87.0% | 2  | 66.7% | 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%   | 230         | 100%  | 3  | 100%  | 110       | 100%  | 3  | 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)

2009/09/07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       |  | 10    | 0.7%  | 1  | 2.9%  |
| 0.1%超 0.2%以下 |  | 100   | 7.5%  | 3  | 8.6%  |
| 0.2%超 0.3%以下 |  | 100   | 7.5%  | 5  | 14.3% |
| 0.3%超 0.4%以下 |  | 270   | 20.2% | 6  | 17.1% |
| 0.4%超 0.5%以下 |  | 160   | 12.0% | 4  | 11.4% |
| 0.5%超 0.6%以下 |  | 175   | 13.1% | 5  | 14.3% |
| 0.6%超 0.7%以下 |  | 60    | 4.5%  | 2  | 5.7%  |
| 0.7%超 0.8%以下 |  | 140   | 10.5% | 3  | 8.6%  |
| 0.8%超 0.9%以下 |  | 30    | 2.2%  | 1  | 2.9%  |
| 0.9%超 1.0%以下 |  | 100   | 7.5%  | 1  | 2.9%  |
| 1.0%超 1.1%以下 |  | 0     | 0.0%  | 0  | 0.0%  |
| 1.1%超 1.2%以下 |  | 100   | 7.5%  | 1  | 2.9%  |
| 1.2%超 1.3%以下 |  | 90    | 6.7%  | 3  | 8.6%  |
| 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           |  | 1,335 | 100%  | 35 | 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%   | 10 | 100.0% | 1             | 100.0% | 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%  | 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

2009/09/07現在

|              |  | 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    |
| 0.1%以下       |  | 0         | 0.0%   | 0          | 0.0%   | 10     | 3.1%  | 1      | 12.5% | 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%   | 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%   | 50     | 15.6% | 1      | 12.5% | 10     | 100.0% | 1  | 100.0% | 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%   | 90  | 37.5% | 3  | 37.5% |
| 0.4%超 0.5%以下 |  | 0         | 0.0%   | 0          | 0.0%   | 100    | 31.3% | 2      | 25.0% | 0      | 0.0%   | 0  | 0.0%   | 0  | 0.0%   | 0  | 0.0%   | 60  | 25.0% | 2  | 25.0% |
| 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%   | 60  | 25.0% | 2  | 25.0% |
| 0.6%超 0.7%以下 |  | 0         | 0.0%   | 0          | 0.0%   | 60     | 18.8% | 2      | 25.0% | 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%   | 100    | 31.3% | 2      | 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  | 12.5% | 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%   | 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%   | 320    | 100%  | 8      | 100%  | 10     | 100%   | 1  | 100%   | 30 | 100%   | 1  | 100%   | 240 | 100%  | 8  | 100%  |

|              |  | 11     |      |          |      | 12     |       |        |       | 13     |       |    |       | 14 |      |    |      | 15 |      |    |      |
|--------------|--|--------|------|----------|------|--------|-------|--------|-------|--------|-------|----|-------|----|------|----|------|----|------|----|------|
|              |  | 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%  | 20     | 18.2% | 1  | 33.3% | 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    | 43.5% | 1      | 33.3% | 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%  | 50     | 45.5% | 1  | 33.3% | 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    | 43.5% | 1      | 33.3% | 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     | 13.0% | 1      | 33.3% | 40     | 36.4% | 1  | 33.3% | 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%   | 230    | 100%  | 3      | 100%  | 110    | 100%  | 3  | 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

2009/09/07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)

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)

2009/09/07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 |  | 120   | 9.0%  | 4  | 11.4% |
| 0.2%超 0.3%以下 |  | 60    | 4.5%  | 2  | 5.7%  |
| 0.3%超 0.4%以下 |  | 240   | 18.0% | 6  | 17.1% |
| 0.4%超 0.5%以下 |  | 80    | 6.0%  | 3  | 8.6%  |
| 0.5%超 0.6%以下 |  | 160   | 12.0% | 3  | 8.6%  |
| 0.6%超 0.7%以下 |  | 120   | 9.0%  | 3  | 8.6%  |
| 0.7%超 0.8%以下 |  | 50    | 3.7%  | 1  | 2.9%  |
| 0.8%超 0.9%以下 |  | 60    | 4.5%  | 2  | 5.7%  |
| 0.9%超 1.0%以下 |  | 100   | 7.5%  | 2  | 5.7%  |
| 1.0%超 1.1%以下 |  | 120   | 9.0%  | 4  | 11.4% |
| 1.1%超 1.2%以下 |  | 15    | 1.1%  | 1  | 2.9%  |
| 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    | 1.5%  | 1  | 2.9%  |
| 1.6%超 1.7%以下 |  | 0     | 0.0%  | 0  | 0.0%  |
| 1.7%超 1.8%以下 |  | 50    | 3.7%  | 1  | 2.9%  |
| 1.8%超 1.9%以下 |  | 40    | 3.0%  | 1  | 2.9%  |
| 1.9%超 2.0%以下 |  | 0     | 0.0%  | 0  | 0.0%  |
| 2.0%超        |  | 100   | 7.5%  | 1  | 2.9%  |
| 総計           |  | 1,335 | 100%  | 35 | 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

2009/09/07現在

(単位:百万円)

|              | 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 |        | 朝日信用金庫 |        | 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%   | 0    | 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   | 18.8% | 2     | 25.0% | 0      | 0.0%   | 0      | 0.0%   | 0      | 0.0%   | 0      | 0.0%   | 30     | 12.5% | 1  | 12.5% |
| 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%   | 30     | 100.0% | 1      | 100.0% | 30     | 12.5% | 1  | 12.5% |
| 0.3%超 0.4%以下 | 30   | 100.0% | 1    | 100.0% | 50   | 15.6% | 1     | 12.5% | 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%  | 10     | 100.0% | 1      | 100.0% | 0      | 0.0%   | 0      | 0.0%   | 30     | 12.5% | 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%   | 60     | 25.0% | 2  | 25.0% |
| 0.6%超 0.7%以下 | 0    | 0.0%   | 0    | 0.0%   | 50   | 15.6% | 1     | 12.5% | 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%   | 30     | 12.5% | 1  | 12.5% |
| 0.9%超 1.0%以下 | 0    | 0.0%   | 0    | 0.0%   | 100  | 31.3% | 2     | 25.0% | 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%   | 60   | 18.8% | 2     | 25.0% | 0      | 0.0%   | 0      | 0.0%   | 0      | 0.0%   | 0      | 0.0%   | 60     | 25.0% | 2  | 25.0% |
| 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%   | 320  | 100%  | 8     | 100%  | 10     | 100%   | 1      | 100%   | 30     | 100%   | 1      | 100%   | 240    | 100%  | 8  | 100%  |

|              | 11     |      |          |      | 12     |       |        |       | 13     |       |        |       | 14     |      |        |      | 15     |      |    |      |
|--------------|--------|------|----------|------|--------|-------|--------|-------|--------|-------|--------|-------|--------|------|--------|------|--------|------|----|------|
|              | 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 |       | 長野信用金庫 |       | 長野信用金庫 |      | 長野信用金庫 |      | 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% | 100    | 43.5% | 1      | 33.3% | 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% | 100    | 43.5% | 1      | 33.3% | 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%  | 20     | 18.2% | 1      | 33.3% | 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     | 13.0% | 1      | 33.3% | 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%  | 50     | 45.5% | 1      | 33.3% | 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     | 36.4% | 1      | 33.3% | 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%   | 230    | 100%  | 3      | 100%  | 110    | 100%  | 3      | 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

2009/09/07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)

2009/09/07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 | 80    | 6.0%  | 2  | 5.7%  |
| 0.1%超  | 0.2%以下 | 70    | 5.2%  | 3  | 8.6%  |
| 0.2%超  | 0.3%以下 | 205   | 15.4% | 6  | 17.1% |
| 0.3%超  | 0.4%以下 | 270   | 20.2% | 8  | 22.9% |
| 0.4%超  | 0.5%以下 | 180   | 13.5% | 5  | 14.3% |
| 0.5%超  | 0.6%以下 | 50    | 3.7%  | 2  | 5.7%  |
| 0.6%超  | 0.7%以下 | 70    | 5.2%  | 2  | 5.7%  |
| 0.7%超  | 0.8%以下 | 30    | 2.2%  | 1  | 2.9%  |
| 0.8%超  | 0.9%以下 | 200   | 15.0% | 3  | 8.6%  |
| 0.9%超  | 1.0%以下 | 80    | 6.0%  | 2  | 5.7%  |
| 1.0%超  | 1.1%以下 | 100   | 7.5%  | 1  | 2.9%  |
| 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     |        | 1,335 | 100%  | 35 | 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 | 0.1%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%   | 10 | 100.0% | 1             | 100.0% | 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%  | 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

2009/09/07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%   | 50           | 15.6% | 1  | 12.5% | 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%   | 30       | 100.0% | 1  | 100.0% | 30        | 12.5% | 1  | 12.5% |
| 0.2%超 0.3%以下 | 30          | 100.0% | 1  | 100.0% | 150          | 46.9% | 3  | 37.5% | 10       | 100.0% | 1  | 100.0% | 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           | 3.1%  | 1  | 12.5% | 0        | 0.0%   | 0  | 0.0%   | 0        | 0.0%   | 0  | 0.0%   | 90        | 37.5% | 3  | 37.5% |
| 0.4%超 0.5%以下 | 0           | 0.0%   | 0  | 0.0%   | 10           | 3.1%  | 1  | 12.5% | 0        | 0.0%   | 0  | 0.0%   | 0        | 0.0%   | 0  | 0.0%   | 30        | 12.5% | 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%   | 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%   | 30        | 12.5% | 1  | 12.5% |
| 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%   | 30        | 12.5% | 1  | 12.5% |
| 0.8%超 0.9%以下 | 0           | 0.0%   | 0  | 0.0%   | 100          | 31.3% | 2  | 25.0% | 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%   | 30        | 12.5% | 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%   | 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%   | 320          | 100%  | 8  | 100%  | 10       | 100%   | 1  | 100%   | 30       | 100%   | 1  | 100%   | 240       | 100%  | 8  | 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% | 30          | 13.0% | 1  | 33.3% | 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% | 100         | 43.5% | 1  | 33.3% | 20        | 18.2% | 1  | 33.3% | 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%  | 40        | 36.4% | 1  | 33.3% | 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% | 100         | 43.5% | 1  | 33.3% | 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%  | 50        | 45.5% | 1  | 33.3% | 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           | 0         | 0%   | 0  | 0%   | 230         | 100%  | 3  | 100%  | 110       | 100%  | 3  | 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)

リスカルク日本版v3.1デフォルト確率分布

2009/09/07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

2009/09/07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 みちのく銀行 | 卸売業, 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               | 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   | 卸売業, 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, 物品賃貸業       | 延滞                  | 2009/4/20  | 未確定            | 31,956,000 | 0             | 50,000,000  |
| 株式会社 広島銀行   | 生活関連サービス業, 娯楽業    | 延滞                  | 2009/5/20  | 未確定            | 61,122,000 | 0             | 100,000,000 |
| 株式会社 広島銀行   | 情報通信業             | 延滞                  | 2009/5/20  | 未確定            | 6,122,000  | 0             | 10,000,000  |
| 株式会社 広島銀行   | 生活関連サービス業, 娯楽業    | 延滞                  | 2009/6/20  | 未確定            | 17,505,000 | 0             | 30,000,000  |
| 株式会社 広島銀行   | 製造業               | 延滞                  | 2009/7/20  | 未確定            | 27,792,000 | 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, 郵便業          | 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   | 卸売業, 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, 郵便業          | 条件緩和                | 2009/7/2   | 未確定            | 34,732,000 | 0             | 50,000,000  |
| 株式会社 中京銀行   | サービス業(他に分類されないもの) | 延滞                  | 2009/7/20  | 未確定            | 27,792,000 | 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  | 生活関連サービス業, 娯楽業    | 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  | 卸売業, 小売業          | 支払不履行               | 2009/2/20  | 2009/6/3       | 38,896,000 | 38,896,000    | 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(合同会社たんぼぼ2008)

【デフォルト債権】

デフォルト債権／延滞債権一覧

2009/09/07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 トマト銀行 | 卸売業, 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 | 学術研究, 専門・技術サービス業  | 法的破綻等(破産手続開始)    | 2009/5/15  | 2009/8/27      | 6,953,000  | 6,953,000     | 10,000,000 |
| 株式会社 トマト銀行 | 卸売業, 小売業          | 延滞               | 2009/5/20  | 未確定            | 30,568,000 | 0             | 50,000,000 |
| 株式会社 トマト銀行 | 卸売業, 小売業          | 支払不履行            | 2009/6/22  | 2009/8/27      | 33,344,000 | 33,344,000    | 50,000,000 |
| 株式会社 トマト銀行 | 卸売業, 小売業          | 支払不履行            | 2009/6/22  | 2009/8/27      | 33,344,000 | 33,344,000    | 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               | 2009/7/20  | 未確定            | 5,568,000  | 0             | 10,000,000 |
| 株式会社 トマト銀行 | 学術研究, 専門・技術サービス業  | 支払不履行            | 2009/7/21  | 2009/8/27      | 31,956,000 | 31,956,000    | 50,000,000 |
| 株式会社 トマト銀行 | 学術研究, 専門・技術サービス業  | 条件緩和             | 2009/8/5   | 未確定            | 6,399,000  | 0             | 10,000,000 |
| 株式会社 トマト銀行 | 宿泊業, 飲食サービス業      | 延滞               | 2009/6/20  | 未確定            | 17,505,000 | 0             | 30,000,000 |
| 仙南信用金庫     | 卸売業, 小売業          | 支払不履行            | 2009/5/20  | 2009/5/20      | 6,953,000  | 6,942,324     | 10,000,000 |
| 飯能信用金庫     | 卸売業, 小売業          | 支払不履行            | 2009/6/22  | 2009/8/27      | 20,004,000 | 19,992,000    | 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     | 卸売業, 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     | 卸売業, 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     | 卸売業, 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     | 卸売業, 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 |

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

2009/09/07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        |
|----------|-------------------|------------------|-----------|----------------|------------|---------------|-------------|
| 朝日信用金庫   | 情報通信業             | 支払不履行            | 2009/6/22 | 2009/9/2       | 20,004,000 | 13,256,435    | 30,000,000  |
| 朝日信用金庫   | 卸売業, 小売業          | 延滞               | 2009/7/20 | 未確定            | 16,672,000 | 0             | 30,000,000  |
| 朝日信用金庫   | 卸売業, 小売業          | 支払不履行            | 2009/7/21 | 2009/8/27      | 19,171,000 | 19,171,000    | 30,000,000  |
| 朝日信用金庫   | 製造業               | 延滞               | 2009/5/20 | 未確定            | 12,230,000 | 0             | 20,000,000  |
| 亀有信用金庫   | 建設業               | 延滞               | 2009/6/20 | 未確定            | 14,590,000 | 0             | 25,000,000  |
| 足立成和信用金庫 | 不動産業, 物品賃貸業       | 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 | 卸売業, 小売業          | 支払不履行            | 2009/2/20 | 2009/5/25      | 23,336,000 | 23,336,000    | 30,000,000  |
| 足立成和信用金庫 | 製造業               | 支払不履行            | 2009/5/20 | 2009/8/27      | 69,453,000 | 69,453,000    | 100,000,000 |
| 足立成和信用金庫 | 卸売業, 小売業          | 延滞               | 2009/9/20 | 未確定            | 5,014,000  | 0             | 10,000,000  |
| 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  |
| 西京信用金庫   | 情報通信業             | 支払不履行            | 2009/5/20 | 2009/5/20      | 13,895,000 | 13,895,000    | 20,000,000  |
| 西京信用金庫   | 不動産業, 物品賃貸業       | 支払不履行            | 2009/7/21 | 2009/8/27      | 31,956,000 | 31,956,000    | 50,000,000  |
| 西京信用金庫   | 不動産業, 物品賃貸業       | 延滞               | 2009/5/20 | 未確定            | 12,230,000 | 0             | 20,000,000  |
| 西京信用金庫   | サービス業(他に分類されないもの) | 延滞               | 2009/5/20 | 未確定            | 18,338,000 | 0             | 30,000,000  |
| 長野信用金庫   | 製造業               | 延滞               | 2009/2/20 | 未確定            | 69,453,000 | 0             | 100,000,000 |
| 長野信用金庫   | 運輸業, 郵便業          | 延滞               | 2009/7/20 | 未確定            | 5,568,000  | 0             | 10,000,000  |
| 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  |

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

2009/09/07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       |
|---------|---------------|------------------|-----------|----------------|------------|---------------|------------|
| 金沢信用金庫  | 宿泊業、飲食サービス業   | 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  | 卸売業、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  | 生活関連サービス業、娯楽業 | 延滞               | 2009/8/20 | 未確定            | 5,291,000  | 0             | 10,000,000 |
| 大阪信用金庫  | 卸売業、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。