

「証券化市場の動向調査」(2006年8月公表分)(注)

【本資料を御覧になる方へのお知らせ(必ずお読みください)】

1. 本資料は、証券化商品のアレンジャー、格付機関などの報告者から任意に報告を受けた個別の証券化商品に関する情報を掲載したものです。
2. 本資料は、証券化市場全体の実勢の把握に資することを目的として作成されたものであり、日本証券業協会及び全国銀行協会として、本資料に掲載されている個別の証券化商品への投資を推奨・勧誘するものではありません。また、市場において個別の証券化商品の発行時に設定される条件の目安を示すものでもありません。
3. 本資料の作成に当たっては、信頼し得ると判断した報告者から報告を受けていますが、報告者は、日本証券業協会及び全国銀行協会に報告する事項について、正確性を保証する責任は負っていません。また、本資料の内容について、日本証券業協会及び全国銀行協会として、正確性を保証するものではありません。なお、掲載されている個別の商品に係る情報は、本資料の「基準日」欄に記載されている日付現在のものであり、格付の変更など、その後変化している可能性があります。

(注) 本調査は、日本国内に所在する特定資産を主たる裏付資産として、2004年4月1日以降に発行された債券、信託受益権、CP(短期社債等、短期外債を含みます。)を対象としています(証券化商品プログラムの下で発行されるものを除きます。)。また、本資料は、日本証券業協会及び全国銀行協会が、2006年7月14日から2006年8月11日までに報告を受けたものを取りまとめています。

発行日 (条件決定日)	案件(発行者)名	オリジネーター	アレンジャー等	発行形式	裏付資産	トランチ	発行金額 (億円)	予定/ 平均年限	法定最終償還日	償還方法	格付					クーポン	スプレッド	基準金利	基準日
											Fitch	JCR	Moody's	R&I	S&P				
2006年7月4日 (2006年6月27日)	CSTR-1信託	クレディ・スイス・ファースト・ホストン・ブリンバ・ル・インベストメンツ・リミテッド 東京支店	クレディ・スイス証券株式会社	信託受益権	商業用不動産担保 ローン債権	A号	81	2.82年	2012年7月10日	3ヶ月毎 バスル	—	—	Aaa	—	—	変動	—	—	2006年7月4日
						B号	15	3.00年	2012年7月10日	3ヶ月毎 バスル	—	—	Aa2	—	—	変動	—	—	2006年7月4日
						C号	14	3.00年	2012年7月10日	3ヶ月毎 バスル	—	—	A2	—	—	変動	—	—	2006年7月4日
						D号	15.5	3.00年	2012年7月10日	3ヶ月毎 バスル	—	—	Baa2	—	—	固定	—	—	2006年7月4日
						X号	125.5	—	2012年7月10日	3ヶ月毎 バスル	—	—	Aaa	—	—	—	—	—	2006年7月4日
2006年7月4日 (2006年6月27日)	CSTR-2信託	クレディ・スイス・ファースト・ホストン・ブリンバ・ル・インベストメンツ・リミテッド 東京支店	クレディ・スイス証券株式会社	信託受益権	商業用不動産担保 ローン債権	E号	20.5	2.89年	2012年7月10日	3ヶ月毎 バスル	—	—	Ba2	—	—	変動	—	—	2006年7月4日
						F号	19.5	2.89年	2012年7月10日	3ヶ月毎 バスル	—	—	B2	—	—	変動	—	—	2006年7月4日
2006年7月20日 (2006年7月18日)	小口手形債権 一括流動化プログラム 優先受益権06-07-01-01	広島銀行取引先	広島銀行 みずほ信託銀行(受託者)	信託受益権	商業手形	優先受益権	7.0	4ヶ月	2006年12月5日	ハード・ブレット	—	—	—	a-1	—	—	—	—	2006年7月20日
2006年7月20日 (2006年7月18日)	東リ・リック手形債権 信託受益権06-07	東リ・リック	三菱UFJ信託銀行	信託受益権	商業手形	優先受益権	7	109日	2006年11月6日	ハード・ブレット	—	—	—	a-1+	—	—	—	—	2006年8月10日
2006年7月21日 (2006年7月18日)	Cafes 1 (カフェーン)	カリヨン銀行 東京支店	カリヨン証券会社 東京支店	信託受益権	商業用不動産	A-1号	25	9.3年	2018年5月	コントロール・ アモチゼーション	AAA	—	Aaa	—	—	—	—	—	2006年8月10日
						A-2号	313	9.3年	2018年5月	コントロール・ アモチゼーション	AAA	—	Aaa	—	—	—	—	3ヶ月LIBOR	2006年8月10日
						B号	64	10年	2018年5月	ハード・ブレット	AA	—	Aa2	—	—	—	—	3ヶ月LIBOR	2006年8月10日
						C-1号	30	10年	2018年5月	ハード・ブレット	A	—	A2	—	—	—	—	—	2006年8月10日
						C-2号	34	10年	2018年5月	ハード・ブレット	A	—	A2	—	—	—	—	3ヶ月LIBOR	2006年8月10日
						D-1号	10	10年	2018年5月	ハード・ブレット	BBB	—	Baa2	—	—	—	—	—	2006年8月10日
						D-2号	56	10年	2018年5月	ハード・ブレット	BBB	—	Baa2	—	—	—	—	3ヶ月LIBOR	2006年8月10日
						X号	532 (想定元本)	—	—	—	AAA	—	Aaa	—	—	—	—	—	2006年8月10日

発行日 (条件決定日)	案件(発行者)名	オリジネーター	アレンジャー等	発行形式	裏付資産	トランチ	発行金額 (億円)	予定/ 平均年限	法定最終償還日	償還方法	格 付					クーポン	スプレッド	基準金利	基準日
											Fitch	JCR	Moody's	R&I	S&P				
2006年7月21日 (2006年7月21日)	Orso Funding CMBS NPL 4信託受益権	ベア・スターンズ(シヤパン) 証券会社 東京支店	ベア・スターンズ(シヤパン) 証券会社 東京支店	信託受益権	商業用不動産	A	148	0.6年	2014年3月31日	—	—	—	—	—	AAA	変動	—	3ヶ月円LIBOR	2006年7月19日
						B	29	1.6年	2014年3月31日	—	—	—	—	—	AA	変動	—	3ヶ月円LIBOR	2006年7月19日
						C	28	1.6年	2014年3月31日	—	—	—	—	—	A	変動	—	3ヶ月円LIBOR	2006年7月19日
						D	31	1.6年	2014年3月31日	—	—	—	—	—	BBB	変動	—	3ヶ月円LIBOR	2006年7月19日
						E	10	1.6年	2014年3月31日	—	—	—	—	—	BB+	変動	—	3ヶ月円LIBOR	2006年7月19日
						F	6	1.6年	2014年3月31日	—	—	—	—	—	BB	変動	—	3ヶ月円LIBOR	2006年7月19日
						X(10)	0	—	2014年3月31日	—	—	—	—	—	AAA	—	—	—	2006年7月19日
2006年7月24日 (2006年7月20日)	旭化成ヘーベルハウス マスタートラスト型RMBS シリーズ2006-4	旭化成モーゲージ	住友信託銀行	信託受益権	住宅ローン債権	シリーズ2006-4 A号優先受益権	12	2.8年	2046年2月28日	バースル	—	—	—	—	AAA	—	—	—	2006年8月11日
						シリーズ2006-4 B号優先受益権	20	12.3年	2046年2月28日	バースル	—	—	—	—	AAA	—	—	—	2006年8月11日
2006年7月25日 (2006年7月21日)	MSNW Trust Certificate Series 06070	デヴィッドソンネットワーク 100%孫会社	農中信託銀行	信託受益権	調剤報酬債権	優先受益権	9.7	40日程度	2006年9月4日	ハードプレット	—	J-1+	—	—	—	—	—	—	2006年8月8日
2006年7月28日 (2006年7月19日)	NCI Trust Certificate-2	野村キャピタル・ インベストメント 野村證券	野村證券	信託受益権	商業用不動産担保 ローン債権・ 特定社債	A号受益権	228	4.4年	2013年9月5日	コントロール・ アフィリエイト	—	—	—	—	AAA	変動	0.38%	3ヶ月円LIBOR	2006年7月19日
						B号受益権	42	5.6年	2013年9月5日	コントロール・ アフィリエイト	—	—	—	—	A	変動	0.68%	3ヶ月円LIBOR	2006年7月19日
						C号受益権	23	5.6年	2013年9月5日	コントロール・ アフィリエイト	—	—	—	—	BBB	変動	1.30%	3ヶ月円LIBOR	2006年7月19日
						D号受益権	14,535	5.6年	2013年9月5日	コントロール・ アフィリエイト	—	—	—	—	BB	変動	3.75%	3ヶ月円LIBOR	2006年7月19日
						R号受益権	3.93	5.6年	2013年9月5日	—	—	—	—	—	実績配当	—	—	—	2006年7月19日
2006年7月28日 (2006年7月19日)	オラクルミュー特定目的会社	オリエント コーポレーション	大和証券SMB	国内公募債	信託受益権 (オートローン債権)	A号特定社債	14	0.25年	2013年7月10日	ソフトプレット	—	—	Aaa	—	AAA	0.52%	0.11%	—	2006年7月28日
						B号特定社債	13	0.50年	2013年7月10日	ソフトプレット	—	—	Aaa	—	AAA	0.60%	0.11%	—	2006年7月28日
						C号特定社債	13	0.75年	2013年7月10日	ソフトプレット	—	—	Aaa	—	AAA	0.69%	0.12%	—	2006年7月28日
						D号特定社債	12	1.00年	2013年7月10日	ソフトプレット	—	—	Aaa	—	AAA	0.79%	0.13%	—	2006年7月28日
						E号特定社債	13	1.25年	2013年7月10日	ソフトプレット	—	—	Aaa	—	AAA	0.86%	0.14%	—	2006年7月28日
						F号特定社債	11	1.50年	2013年7月10日	ソフトプレット	—	—	Aaa	—	AAA	0.94%	0.15%	—	2006年7月28日
						G号特定社債	11	1.75年	2013年7月10日	ソフトプレット	—	—	Aaa	—	AAA	1.00%	0.15%	—	2006年7月28日
						H号特定社債	9	2.00年	2013年7月10日	ソフトプレット	—	—	Aaa	—	AAA	1.07%	0.16%	—	2006年7月28日
						I号特定社債	9	2.25年	2013年7月10日	ソフトプレット	—	—	Aaa	—	AAA	1.13%	0.16%	—	2006年7月28日
						J号特定社債	8	2.50年	2013年7月10日	ソフトプレット	—	—	Aaa	—	AAA	1.19%	0.16%	—	2006年7月28日
						K号特定社債	8	2.75年	2013年7月10日	ソフトプレット	—	—	Aaa	—	AAA	1.25%	0.16%	—	2006年7月28日
						L号特定社債	6	3.00年	2013年7月10日	ソフトプレット	—	—	Aaa	—	AAA	1.31%	0.17%	—	2006年7月28日
						M号特定社債	5	3.25年	2013年7月10日	ソフトプレット	—	—	Aaa	—	AAA	1.37%	0.18%	—	2006年7月28日
						N号特定社債	4	3.50年	2013年7月10日	ソフトプレット	—	—	Aaa	—	AAA	1.42%	0.18%	—	2006年7月28日
2006年7月28日 (2006年7月21日)	ヴィーナストラスト 優先受益権及びABL	—	みずほ証券	信託受益権	住宅ローン債権	A号優先受益権	85	—	2035年2月27日	3ヶ月毎 バースル	—	—	Aaa	—	—	—	—	—	2006年7月28日
				A B L	住宅ローン債権	責任財産限定 特約付ローン	10	—	2035年2月27日	1ヶ月毎 バースル	—	—	Aaa	—	—	—	—	—	2006年7月28日
				信託受益権	住宅ローン債権	C号優先受益権	0.04	—	2035年2月27日	1ヶ月毎 バースル	—	—	Aa1	—	—	—	—	—	2006年7月28日
2006年7月28日 (2006年7月21日)	第六回 日本商エリース リース料債権信託優先受益権	日本商エリース	大和証券SMB	信託受益権	リース料債権	優先受益権	50.9	—	2011年12月19日	コントロール・ アフィリエイト	—	—	—	AAA	—	—	—	—	2006年7月28日

発行日 (条件決定日)	案件(発行者)名	オリジネーター	アレンジャー等	発行形式	裏付資産	トランチ	発行金額 (億円)	予定/ 平均年限	法定最終償還日	償還方法	格 付					クーポン	スプレッド	基準金利	基準日
											Fitch	JCR	Moody's	R&I	S&P				
2006年7月31日 (2006年7月20日)	クレア・イレブン特定目的会社	オリエント コーポレーション	みずほ証券	国内私募債	信託受益権 (カードローン債権 及びクレジット債権)	A1	46	2.3年	2012年7月14日	1年後から 1ヶ月毎 コントロールド・ プレイジョン	—	—	Aaa	—	AAA	—	—	—	2006年7月31日
						A2	165	2.3年	2012年7月14日	1年後から 1ヶ月毎 コントロールド・ プレイジョン	—	—	Aaa	—	AAA	—	—	—	2006年7月31日
						B	27	2.3年	2012年7月14日	1年後から 1ヶ月毎 コントロールド・ プレイジョン	—	—	A2	—	A	—	—	—	2006年7月31日
						C	12	2.3年	2012年7月14日	1年後から 1ヶ月毎 コントロールド・ プレイジョン	—	—	Baa2	—	BBB	—	—	—	2006年7月31日
2006年7月31日 (2006年7月25日)	HC・リーストラスト シリーズ20	日立キャピタル	日立キャピタル みずほ信託銀行(受託者)	信託受益権	信託受益権 (リース料債権)	優先受益権	121	—	2013年5月31日	1ヶ月毎 コントロールド・ プレイジョン	—	—	—	AAA	—	—	—	—	2006年7月31日
				信託受益権	信託受益権 (リース料債権)	優先受益権	27.5	—	2013年5月31日	1ヶ月毎 パススルー	—	—	—	AAA	—	—	—	—	2006年7月31日
				ABL	信託受益権 (リース料債権)	特定借入	21	—	2013年5月31日	1ヶ月毎 コントロールド・ プレイジョン	—	—	—	AAA	—	—	—	—	2006年7月31日
2006年7月31日 (2006年7月27日)	手形債権流動化プログラム 日販売受益権信託受益権 06-05-01	日販売	みずほ信託銀行	信託受益権	信託受益権 (商業手形)	優先受益権	2.6	2ヶ月	2006年10月4日	ハードプ レット	—	—	—	a-1+	—	—	—	—	2006年7月31日
2006年7月31日 (2006年7月27日)	手形債権流動化プログラム 日販売受益権信託受益権 06-06-01	日販売	みずほ信託銀行	信託受益権	信託受益権 (商業手形)	優先受益権	5.2	3ヶ月	2006年11月2日	ハードプ レット	—	—	—	a-1+	—	—	—	—	2006年7月31日
2006年7月31日 (2006年7月27日)	手形債権流動化プログラム 日販売受益権信託受益権 06-07-01	日販売	みずほ信託銀行	信託受益権	信託受益権 (商業手形)	優先受益権	2.7	4ヶ月	2006年12月4日	ハードプ レット	—	—	—	a-1+	—	—	—	—	2006年7月31日
2006年7月31日 (2006年7月27日)	平成ポリマー手形債権 ABL06-07 平成ポリマー手形債権 信託受益権06-07	平成ポリマー	三菱UFJ信託銀行	ABL	商業手形	ABL	2	4ヶ月	2006年11月24日	ハードプ レット	—	—	—	a-2	—	—	—	—	2006年8月10日
				信託受益権	商業手形	優先受益権	0.2	4ヶ月	2006年11月24日	ハードプ レット	—	—	—	a-2	—	—	—	—	2006年8月10日
2006年7月31日 (2006年7月27日)	第11回住商リース・ リース料債権信託優先受益権	住商リース	住友信託銀行	信託受益権	リース料債権	優先第1受益権	2	—	2014年2月24日	ソフトプ レット	—	—	—	—	AAA	—	—	—	2006年8月11日
						優先第2受益権	2	—	2014年2月24日	ソフトプ レット	—	—	—	—	AAA	—	—	—	2006年8月11日
						優先第3受益権	5	—	2014年2月24日	ソフトプ レット	—	—	—	—	AAA	—	—	—	2006年8月11日
						優先第4受益権	5	—	2014年2月24日	ソフトプ レット	—	—	—	—	AAA	—	—	—	2006年8月11日
						優先第5受益権	286	—	2014年2月24日	コントロールド・ プレイジョン	—	—	—	—	AAA	—	—	—	2006年8月11日
2006年7月31日 (—)	OTB住宅ローン債権 信託受益権No.3	—	—	—	住宅ローン債権	優先ローン	200	—	2032年4月	—	—	—	—	—	AAA	—	—	—	2006年7月31日
						メザニン受益権	10	—	2032年4月	—	—	—	—	—	BBB	—	—	—	2006年7月31日
2006年8月3日 (—)	三菱東京UFJ銀行 住宅ローン債権 信託受益権2006-3 (適格機関投資家間限定 転売分付少数私募)	三菱東京UFJ銀行	三菱UFJ証券	信託受益権	住宅ローン債権	優先受益権 (変動)	2,727	—	2043年2月25日	1ヶ月毎 パススルー	—	—	Aaa	—	AAA	—	—	—	2006年8月3日
						優先受益権 (固定)	320	—	2043年2月25日	1ヶ月毎 パススルー	—	—	Aaa	—	AAA	—	—	—	2006年8月3日
2006年8月7日 (2006年7月26日)	貸付債権担保第45回 住宅金融公庫債券	住宅金融公庫	野村證券(事務幹事) ゴールドマン・サックス証券 日興シティグループ証券	国内公募債	住宅ローン債権	—	614	—	2041年8月10日	1ヶ月毎 パススルー	—	—	—	AAA	AAA	2.33%	0.45%	JGB第281回債	2006年7月26日
2006年8月7日 (—)	NRF Trust 2006-1	—	—	—	住宅ローン債権	1号	30	—	2043年2月	—	—	—	—	—	AAA	—	—	—	2006年8月7日
						2号	30	—	2041年8月	—	—	—	—	—	AAA	—	—	—	2006年8月7日
2006年8月8日 (2006年7月27日)	貸付債権担保S種第7回 住宅金融公庫債券	住宅金融公庫	野村證券(事務幹事) ゴールドマン・サックス証券 日興シティグループ証券	国内公募債	住宅ローン債権	—	2,500	—	2037年5月10日	1ヶ月毎 パススルー	—	—	—	AAA	AAA	2.25%	0.54%	JGB第259回債	2006年7月27日
2006年8月8日 (—)	JCOM 2006-3信託受益権	—	—	—	住宅ローン債権	F号	100	—	2037年5月	—	—	—	—	—	AAA	—	—	—	2006年8月8日
						I号	100	—	2037年5月	—	—	—	—	—	AAA	—	—	—	2006年8月8日

発行日 (条件決定日)	案件(発行者)名	オリジネーター	アレンジャー等	発行形式	裏付資産	トランチ	発行金額 (億円)	予定/ 平均年限	法定最終償還日	償還方法	格 付					クーポン	スプレッド	基準金利	基準日
											Fitch	JCR	Moody's	R&I	S&P				
2006年8月10日 (2006年7月27日)	インターメッツオIV リミテッド	—	Mizuho International plc	ユーロ債	CDS契約 金利スワップ契約 担保債 (日本国債第242回債)	A1	28	6.16年	2013年1月24日	プレット	—	—	—	AA-	—	—	—	—	2006年8月10日
						A2	10	6.16年	2013年1月24日	プレット	—	—	—	AA-	—	—	—	—	2006年8月10日
						B1	57	6.16年	2013年1月24日	プレット	—	—	—	A-	—	—	—	—	2006年8月10日
						C1	5	6.16年	2013年1月24日	プレット	—	—	—	BBB+	—	—	—	—	2006年8月10日
2006年8月10日 (2006年7月27日)	JLOC XXXI信託受益権	モルガン・スタンレー証券	モルガン・スタンレー証券 DB信託	信託受益権	商業用不動産	A	216	4.9年	2015年2月15日	3ヶ月毎 バースデー	AAA	—	Aaa	—	AAA	変動	0.33%	3ヶ月円LIBOR	2006年8月11日
						B	11	5.4年	2015年2月15日	3ヶ月毎 バースデー	AA	—	Aa2	—	AA	変動	0.50%	3ヶ月円LIBOR	2006年8月11日
						C	9	5.1年	2015年2月15日	3ヶ月毎 バースデー	A	—	A2	—	A	変動	0.70%	3ヶ月円LIBOR	2006年8月11日
						D	7	5.4年	2015年2月15日	3ヶ月毎 バースデー	BBB	—	Baa2	—	BBB	3%	—	固定	2006年8月11日
						X(10)	243 (想定元本)	—	—	—	AAA	—	Aaa	—	AAA	—	—	—	2006年8月11日
2006年8月11日 (2006年7月28日)	第一生命第3回基金流動化 特定目的会社	みずほコーポレート銀行 (基金調達者:第一生命 保険相互会社)	みずほ証券	国内公募債	基金債権	—	600	5年/5年	2011年8月	ハードプレット	—	—	—	A	BBB+	1.96%	—	—	2006年8月11日
2006年8月11日 (2006年8月2日)	SMBC第8回住宅ローン信託受益権	三井住友銀行	大和証券SMBIC	信託受益権	住宅ローン債権	クラスA1 信託受益権	455	—	2043年5月31日	1ヶ月毎 バースデー	—	—	Aaa	—	AAA	1.77%	—	—	2006年8月11日
						クラスA2 信託受益権	555	—	2043年5月31日	1ヶ月毎 バースデー	—	—	Aaa	—	AAA	2.67%	—	—	2006年8月11日