

「証券化市場の動向調査」（2006年1月公表分）（注）

【本資料をご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、日本銀行として、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はありません。
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、日本銀行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、日本銀行として、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かかる情報は、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、C P（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、日本銀行が、2005年12月14日から2006年1月17日の間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 ¹	基準金利	基準日
											Fitch	JCR	Moody's	R&I	S&P				
2005年12月14日 （2005年12月6日）	S M B C 第5回 住宅ローン信託受益権	三井住友銀行	大和証券SMBC	信託受益権	住宅ローン債権	クラスA1	950	-	2042年11月30日	1ヶ月毎 パスト	-	-	Aaa	-	AAA	1.19%	-	-	2005年12月14日
						クラスA2	760	-	2042年11月30日	1ヶ月毎 パスト	-	-	Aaa	-	AAA	2.23%	-	-	2005年12月14日
2005年12月19日 （2005年12月6日）	JLOC XXIX信託	-	モルガン・スタンレー証券会社 新生信託銀行	信託受益権	商業用不動産	A	393	0.8年	2012年6月11日	-	AAA	-	Aaa	-	AAA	-	0.18%	1ヶ月 円LIBOR	2006年1月13日
						B	72	0.9年	2012年6月11日	-	AA	-	Aa2	-	AA	-	0.30%	1ヶ月 円LIBOR	2006年1月13日
						C	64	1.0年	2012年6月11日	-	A	-	A2	-	A	-	0.50%	1ヶ月 円LIBOR	2006年1月13日
						D	34	1.8年	2012年6月11日	-	BBB	-	Baa2	-	BBB	-	1.00%	1ヶ月 円LIBOR	2006年1月13日
						X （IO）	563 （想定元本）	-	2012年6月11日	-	AAA	-	Aaa	-	AAA	-	-	-	2006年1月13日
2005年12月20日 （2005年12月16日）	小口手形債権 一括流動化プログラム 優先受益権05-12-01-01	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	2.5	2ヶ月	2006年3月3日	ハードプレート	-	-	-	a-1	-	-	-	-	2005年12月20日
2005年12月20日 （2005年12月16日）	小口手形債権 一括流動化プログラム 優先受益権05-12-01-02	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	4.6	3ヶ月	2006年4月5日	ハードプレート	-	-	-	a-1	-	-	-	-	2005年12月20日
2005年12月20日 （2005年12月16日）	小口手形債権 一括流動化プログラム 優先受益権05-12-01-03	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	1.0	4ヶ月	2006年5月9日	ハードプレート	-	-	-	a-1	-	-	-	-	2005年12月20日
2005年12月20日 （2005年12月16日）	三洋電機クレジット・ リース料債権信託受益権	三洋電機クレジット 株式会社	大和証券SMBC	信託受益権	リース料債権	-	200	3.05年	-	6ヶ月毎 コントロール・ アフェクション	-	-	-	AAA	AAA	-	-	-	2005年12月20日
2005年12月20日 （2005年12月16日）	東リ・リック手形債権 信託受益権05-12	東リ（株）・ リック（株）	三菱UFJ信託銀行	信託受益権	商業手形	優先受益権	9	106日	2006年4月5日	ハードプレート	-	-	-	a-1+	-	-	-	-	2006年1月5日
2005年12月20日 （2005年12月16日）	株式会社ニシケン手形債権 信託受益権05-12	株式会社ニシケン	西日本シティ銀行	信託受益権	商業手形	優先受益権	5	0.33年	2006年4月7日	コントロール・ アフェクション	-	J-1	-	-	-	-	-	-	2006年1月17日
2005年12月22日 （2005年12月6日）	第2回地域金融機関CLO 貸付債権信託受益権	中小企業金融公庫	大和証券SMBC	信託受益権	企業向け貸付債権	優先受益権	176	3.1年	2010年1月15日	3ヶ月毎 コントロール・ アフェクション	-	-	Aaa	AAA	-	0.53%	-	-	2005年12月22日
						メザニン受益権	3.1	3.1年	2010年1月15日	3ヶ月毎 コントロール・ アフェクション	-	-	A1	AA	-	0.65%	-	-	2005年12月22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	ｽﾌﾟﾚｯﾄﾞ	基準金利	基準日
											Fitch	JCR	Moody's	R&I	S&P				
2005年12月22日 (2005年12月8日)	クレア・ナイン特定目的会社	株式会社オリエント 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)	A	166	2.29年	2011年12月14日	1年後から 1ヶ月毎 ｺﾝﾄﾛｰﾙﾄﾞ・ ﾌｪﾔﾁﾍﾞｰｼｮﾝ	-	-	Aaa	-	AAA	-	-	-	2005年12月22日
						B	25	2.29年	2011年12月14日	1年後から 1ヶ月毎 ｺﾝﾄﾛｰﾙﾄﾞ・ ﾌｪﾔﾁﾍﾞｰｼｮﾝ	-	-	A2	-	A	-	-	-	2005年12月22日
						C	9	2.29年	2011年12月14日	1年後から 1ヶ月毎 ｺﾝﾄﾛｰﾙﾄﾞ・ ﾌｪﾔﾁﾍﾞｰｼｮﾝ	-	-	Baa2	-	BBB	-	-	-	2005年12月22日
2005年12月22日 (2005年12月13日)	第2回楽天KCカード・トラスト	楽天KC株式会社	みずほ証券 オリックス信託銀行	信託受益権	カードローン債権	A号優先受益権	170	3年	2013年12月18日	2年後から 1ヶ月毎 ﾊﾞｽﾄﾙｰ	-	-	Aaa	AAA	-	-	-	-	2005年12月22日
						B号優先受益権	35	3年	2013年12月18日	2年後から 3ヶ月毎 ﾊﾞｽﾄﾙｰ	-	-	Baa2	BBB	-	-	-	-	2005年12月22日
2005年12月22日 (2005年12月16日)	オリックスリーストラスト6号	オリックス株式会社	オリックス株式会社	信託受益権	リース料債権	A号	20	5年/2.5年	2013年6月30日	1ヶ月毎 ﾊﾞｽﾄﾙｰ	-	-	Aaa	-	-	-	-	-	2005年12月16日
				信託受益権	リース料債権	B号	210	5年/2.5年	2013年6月30日	ｺﾝﾄﾛｰﾙﾄﾞ・ ﾌｪﾔﾁﾍﾞｰｼｮﾝ	-	-	Aaa	-	-	-	-	-	2005年12月16日
				A B L	リース料債権	-	170	5年/2.5年	2013年6月30日	1ヶ月毎 ﾊﾞｽﾄﾙｰ	-	-	Aaa	-	-	-	-	-	2005年12月16日
2005年12月22日 (2005年12月16日)	日立キャピタル第8回 住宅ローン債権信託受益権	日立キャピタル株式会社	J.P.モルガン証券会社	信託受益権	住宅ローン債権	優先受益権	282	-	2041年3月10日	1ヶ月毎 ﾊﾞｽﾄﾙｰ	-	-	-	-	AAA	-	-	-	2005年12月22日
2005年12月22日 (2005年12月19日)	レジェンド トラスト	-	みずほ証券	信託受益権	商業用不動産	A1	77	7年	2014年12月	ｺﾝﾄﾛｰﾙﾄﾞ・ ﾌｪﾔﾁﾍﾞｰｼｮﾝ	-	-	Aaa	-	-	-	-	-	2005年12月22日
						A2	373	7年	2014年12月	ｼｵﾌﾞﾌﾟﾚｯﾄ	-	-	Aaa	-	-	-	-	-	2005年12月22日
						B	87	7年	2014年12月	ｼｵﾌﾞﾌﾟﾚｯﾄ	-	-	Aa2	-	-	-	-	-	2005年12月22日
						C	87	7年	2014年12月	ｼｵﾌﾞﾌﾟﾚｯﾄ	-	-	A2	-	-	-	-	-	2005年12月22日
						D	98	7年	2014年12月	ｼｵﾌﾞﾌﾟﾚｯﾄ	-	-	Baa2	-	-	-	-	-	2005年12月22日
						E	258	7年	2014年12月	ｼｵﾌﾞﾌﾟﾚｯﾄ	-	-	B2	-	-	-	-	-	2005年12月22日
						F	5	7年	2014年12月	ｼｵﾌﾞﾌﾟﾚｯﾄ	-	-	B3	-	-	-	-	-	2005年12月22日
						G	5	7年	2014年12月	ｼｵﾌﾞﾌﾟﾚｯﾄ	-	-	-	-	-	-	-	-	2005年12月22日
2005年12月22日 (-)	-	-	-	信託受益権	商業用不動産を 裏付とした特定社債	A	66	-	-	ｱﾝｺﾝﾄﾛｰﾙﾄﾞ・ ﾌｪﾔﾁﾍﾞｰｼｮﾝ	AAA	-	Aaa	-	-	-	-	-	2005年12月22日
						B	15	-	-	ｱﾝｺﾝﾄﾛｰﾙﾄﾞ・ ﾌｪﾔﾁﾍﾞｰｼｮﾝ	AA	-	Aa2	-	-	-	-	-	2005年12月22日
						C	14	-	-	ｱﾝｺﾝﾄﾛｰﾙﾄﾞ・ ﾌｪﾔﾁﾍﾞｰｼｮﾝ	A	-	A2	-	-	-	-	-	2005年12月22日
						D	10	-	-	ｱﾝｺﾝﾄﾛｰﾙﾄﾞ・ ﾌｪﾔﾁﾍﾞｰｼｮﾝ	BBB	-	Baa2	-	-	-	-	-	2005年12月22日
						R	3	-	-	ｱﾝｺﾝﾄﾛｰﾙﾄﾞ・ ﾌｪﾔﾁﾍﾞｰｼｮﾝ	AAA	-	Aaa	-	-	-	-	-	2005年12月22日
						X (IO)	108 (想定元本)	-	-	ｱﾝｺﾝﾄﾛｰﾙﾄﾞ・ ﾌｪﾔﾁﾍﾞｰｼｮﾝ	AAA	-	Aaa	-	-	-	-	-	2005年12月22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				
2005年12月30日 (2005年12月28日)	手形債権流動化プログラム 日発売売受益権信託受益権 05-10-01	日発売株式会社	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	3.1	2ヶ月	2006年3月2日	ハード・ブレット	-	-	-	a-1+	-	-	-	-	2005年12月30日
2005年12月30日 (2005年12月28日)	手形債権流動化プログラム 日発売売受益権信託受益権 05-11-01	日発売株式会社	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	6.5	3ヶ月	2006年4月4日	ハード・ブレット	-	-	-	a-1+	-	-	-	-	2005年12月30日
2005年12月30日 (2005年12月28日)	手形債権流動化プログラム 日発売売受益権信託受益権 05-12-01	日発売株式会社	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	2.9	4ヶ月	2006年5月8日	ハード・ブレット	-	-	-	a-1+	-	-	-	-	2005年12月30日
2006年1月11日 (2005年12月21日)	貸付債権担保第38回 住宅金融公庫債券	住宅金融公庫	みずほ証券(事務主幹事) クレディスイスファースト・ベスト 証券会社東京支店 ゴールドマン・サックス証券会社東京支店	国内公募債	住宅ローン債権	-	765	-	2041年1月10日	1ヶ月毎 パドル	-	-	-	AAA	AAA	1.91%	0.37%	1.54% JGB274回債	2006年1月11日

以 上