

「証券化市場の動向調査」（2005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、2004年12月14日から2005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	基準金利	基準日
											Fitch	JCR	Moody's	R&I	S&P				
2004年12月14日 (-)	W4S20信託	-	-	-	商業用不動産	A号受益権	31.6	-	2010年	-	-	-	-	-	AAA	-	-	-	2004年12月14日
						B号受益権	7	-	2010年	-	-	-	-	-	AA	-	-	-	2004年12月14日
						C号受益権	7	-	2010年	-	-	-	-	-	A	-	-	-	2004年12月14日
						D号受益権	6.9	-	2010年	-	-	-	-	-	BBB	-	-	-	2004年12月14日
						X1号受益権	-	-	2010年	-	-	-	-	-	AAA	-	-	-	2004年12月14日
2004年12月16日 (2004年12月6日)	インターメツソ リミテッド	-	みずほ証券	ユーロ債	CDS契約、 金利スワップ契約、 担保債（日本国債）	クラスA1	11	6.3年	2011年7月24日	ブレット	-	-	-	AA-	-	-	-	-	2004年12月16日
						クラスA2	13	6.3年	2011年7月24日	ブレット	-	-	-	AA-	-	-	-	-	2004年12月16日
						クラスB1	11	6.3年	2011年7月24日	ブレット	-	-	-	A-	-	-	-	-	2004年12月16日
						クラスB2	3	6.3年	2011年7月24日	ブレット	-	-	-	A-	-	-	-	-	2004年12月16日
						クラスC	5	6.3年	2011年7月24日	ブレット	-	-	-	BBB+	-	-	-	-	2004年12月16日
						クラスD	5	6.3年	2011年7月24日	ブレット	-	-	-	BBB	-	-	-	-	2004年12月16日
						クラスE	9	6.3年	2011年7月24日	ブレット	-	-	-	BBB-	-	-	-	-	2004年12月16日
2004年12月17日 (2004年12月1日)	三都市CLO特定目的会社	三井住友銀行 他計14金融機関	大和証券SMBC 住友信託銀行(受託者)	国内公募債	企業向け貸付債権	A号	10	2.25年	2007年4月4日	ハードブレット	-	-	-	AAA	-	0.40%	-	-	2004年12月17日
						B号	10	2.5年	2007年7月4日	ハードブレット	-	-	-	AAA	-	0.44%	-	-	2004年12月17日
						C号	10	2.75年	2007年10月4日	ハードブレット	-	-	-	AAA	-	0.47%	-	-	2004年12月17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				
2004年12月17日 (2004年12月7日)	広域型地方銀行 C B O	みずほ銀行	みずほ銀行	信託受益権	社債	シニア 受益権	11.1	3年	2008年3月	ハード・ブレット	-	-	-	-	AA	-	-	-	2005年1月17日
						メザニン 受益権	1.71	3年	2008年3月	ハード・ブレット	-	-	-	-	BBB	-	-	-	2005年1月17日
2004年12月17日 (2004年12月14日)	OrangeCat トラストファンディング	芙蓉総合リース(株)	みずほ信託銀行	信託受益権	リース料債権	A-1号 優先受益権	9	0.25年	2010年9月7日	ソフト・ブレット	-	-	-	AAA	-	-	-	-	2004年12月30日
						A-2号 優先受益権	14	0.50年	2010年9月7日	ソフト・ブレット	-	-	-	AAA	-	-	-	-	2004年12月30日
						A-3号 優先受益権	14	0.75年	2010年9月7日	ソフト・ブレット	-	-	-	AAA	-	-	-	-	2004年12月30日
						A-4号 優先受益権	14	1.00年	2010年9月7日	ソフト・ブレット	-	-	-	AAA	-	-	-	-	2004年12月30日
						A-5号 優先受益権	130	2.40年	2010年9月7日	ソフト・ブレット	-	-	-	AAA	-	-	-	-	2004年12月30日
						B号 優先受益権	30	1.95年	2010年9月7日	ソフト・ブレット	-	-	-	AAA	-	-	-	-	2004年12月30日
2004年12月20日 (2004年12月9日)	第1回KCマネーカード・ トラスト	国内信販株式会社	みずほ証券 農中信託銀行	信託受益権	カードローン債権	A号 信託受益権	187	3年	2012年12月18日	ソフト・ブレット	-	-	Aaa	AAA	-	-	-	-	2005年1月5日
						B号 信託受益権	63	3年	2012年12月18日	ソフト・ブレット	-	-	Baa2	BBB	-	-	-	-	2005年1月5日
2004年12月20日 (2004年12月16日)	小口手形債権一括流動化 ファンド優先受益権 04-12-01-01	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	1.3	2ヶ月	2005年3月3日	ハード・ブレット	-	-	-	a-1+	-	-	-	-	2004年12月30日
2004年12月20日 (2004年12月16日)	小口手形債権一括流動化 ファンド優先受益権 04-12-01-02	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	2.6	3ヶ月	2005年4月5日	ハード・ブレット	-	-	-	a-1+	-	-	-	-	2004年12月30日
2004年12月20日 (2004年12月16日)	小口手形債権一括流動化 ファンド優先受益権 04-12-01-03	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	2005年5月10日	ハード・ブレット	-	-	-	a-1+	-	-	-	-	2004年12月30日
2004年12月20日 (2004年12月16日)	東リ・リック手形債権 信託受益権04-12	東リ(株)・ リック(株)	UFJ信託銀行	信託受益権	商業手形	優先受益権	8.9	106日	2005年4月5日	ハード・ブレット	-	-	-	a-1+	-	-	-	-	2005年1月17日
2004年12月21日 (2004年12月14日)	ノーローン クリスタル ファンディング	新生銀行	新生銀行	サムライ私募債	信託受益権	-	84	4.15年	2012年3月26日	ソフト・ブレット	-	-	-	-	AAA	-	0.45%	1ヶ月 円LIBOR	2004年12月21日
2004年12月22日 (2004年12月10日)	オラクルカッパ特定目的会社	オリエント コーポレーション	大和証券SMBC	国内公募債	オートローン債権	A	25	3ヶ月	2011年12月10日	ソフト・ブレット	-	-	Aaa	-	AAA	-	-	-	2004年12月30日
						B	21	6ヶ月	2011年12月10日	ソフト・ブレット	-	-	Aaa	-	AAA	-	-	-	2004年12月30日
						C	20	9ヶ月	2011年12月10日	ソフト・ブレット	-	-	Aaa	-	AAA	-	-	-	2004年12月30日
						D	16	12ヶ月	2011年12月10日	ソフト・ブレット	-	-	Aaa	-	AAA	-	-	-	2004年12月30日
						E	19	15ヶ月	2011年12月10日	ソフト・ブレット	-	-	Aaa	-	AAA	-	-	-	2004年12月30日
						F	15	18ヶ月	2011年12月10日	ソフト・ブレット	-	-	Aaa	-	AAA	-	-	-	2004年12月30日
						G	13	21ヶ月	2011年12月10日	ソフト・ブレット	-	-	Aaa	-	AAA	-	-	-	2004年12月30日
						H	9	24ヶ月	2011年12月10日	ソフト・ブレット	-	-	Aaa	-	AAA	-	-	-	2004年12月30日
						I	9	27ヶ月	2011年12月10日	ソフト・ブレット	-	-	Aaa	-	AAA	-	-	-	2004年12月30日
						J	7	30ヶ月	2011年12月10日	ソフト・ブレット	-	-	Aaa	-	AAA	-	-	-	2004年12月30日
						K	6	33ヶ月	2011年12月10日	ソフト・ブレット	-	-	Aaa	-	AAA	-	-	-	2004年12月30日
						L	5	36ヶ月	2011年12月10日	ソフト・ブレット	-	-	Aaa	-	AAA	-	-	-	2004年12月30日
						M	5	39ヶ月	2011年12月10日	ソフト・ブレット	-	-	Aaa	-	AAA	-	-	-	2004年12月30日
						N	4	42ヶ月	2011年12月10日	ソフト・ブレット	-	-	Aaa	-	AAA	-	-	-	2004年12月30日
						O	3	45ヶ月	2011年12月10日	ソフト・ブレット	-	-	Aaa	-	AAA	-	-	-	2004年12月30日
						P	2	48ヶ月	2011年12月10日	ソフト・ブレット	-	-	Aaa	-	AAA	-	-	-	2004年12月30日
						Q	85	27ヶ月	2011年12月10日	ソフト・ブレット	-	-	Aaa	-	AAA	-	-	-	2004年12月30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				
2004年12月22日 (2004年12月15日)	中小企業金融公庫 C L O (第1回保証型)	みずほ銀行	みずほ証券 みずほ信託銀行	信託受益権	企業向け貸付債権 (中小企業金融公庫に よる7割の部分保証付 中小企業向け貸付債権)	優先受益権	426.7	5.14年	2012年2月10日	3ヶ月毎 元金元金	-	-	Aaa	-	-	0.55%	-	-	2004年12月22日
2004年12月22日 (-)	第十回協同リース リース料債権 信託受益権	協同リース	三菱信託銀行	信託受益権	リース料債権	第1号～第42号 優先受益権	157.9	2ヶ月～43ヶ月	2010年1月31日	ワットレット	-	-	-	AAA	-	-	-	-	2004年12月22日
						第43号 優先受益権	42.1	-	2010年1月31日	1ヶ月毎 元金元金	-	-	-	AAA	-	-	-	-	2004年12月22日
2004年12月27日 (2004年12月10日)	クレア・シックス特定目的会社	オリエン 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	154	2.04年	2010年12月14日	1年後から 元金元金・ 元金元金・ 元金元金	-	-	Aaa	-	AAA	-	-	-	2004年12月30日
						B	46	2.02年	2010年12月14日	1年後から 元金元金・ 元金元金・ 元金元金	-	-	Baa2	-	BBB	-	-	-	2004年12月30日
2004年12月27日 (2004年12月17日)	中央三井信託銀行株式会社 第4回住宅ローン債権信託受益権	中央三井信託銀行	大和証券SMBC(主幹事) 日興証券(共同主幹事) 三井信託銀行(受託者)	信託受益権	住宅ローン債権	A1	500	-	2040年8月13日	1ヶ月毎 元金元金	-	-	Aaa	-	-	-	-	-	2004年12月27日
						A2	530	-	2040年8月13日	1ヶ月毎 元金元金	-	-	Aaa	-	-	-	-	-	2004年12月27日
2004年12月27日 (2004年12月20日)	シリーズ2004-2005優先受益権B	オリエン コーポレーション	みずほ証券 みずほ信託銀行	信託受益権	カードローン債権 及びクレジット債権	CC優先受益権B	100	2.00年	2010年11月30日	1年後から 元金元金・ 元金元金・ 元金元金	-	-	Aaa	-	AAA	-	-	-	2004年12月30日
2004年12月28日 (-)	第4回プライム信託受益権	(株)プライム	エアーズシー証券	信託受益権	消費者ローン債権	A号優先受益権	9.9	-	2012年12月28日	1ヶ月毎 元金元金	-	-	-	A	-	-	-	-	2004年12月28日
						B号優先受益権	0.1	-	2012年12月28日	1ヶ月毎 元金元金	-	-	-	A	-	-	-	-	2004年12月28日
2004年12月29日 (2004年12月22日)	U F J セントラルリース マスタートラスト シリーズ7	U F J セントラルリース	U F J セントラルリース U F J 信託銀行	信託受益権	リース料債権	第77優先受益権 (7-A1)	9	1ヶ月	2009年12月30日	ワットレット	-	-	-	-	AAA	-	-	-	2004年12月29日
						第78優先受益権 (7-A2)	8.2	2ヶ月	2009年12月30日	ワットレット	-	-	-	-	AAA	-	-	-	2004年12月29日
						第79優先受益権 (7-A3)	6.4	3ヶ月	2009年12月30日	ワットレット	-	-	-	-	AAA	-	-	-	2004年12月29日
						第80優先受益権 (7-A4)	6.7	4ヶ月	2009年12月30日	ワットレット	-	-	-	-	AAA	-	-	-	2004年12月29日
						第81優先受益権 (7-A5)	6.1	5ヶ月	2009年12月30日	ワットレット	-	-	-	-	AAA	-	-	-	2004年12月29日
						第82優先受益権 (7-A6)	5.6	6ヶ月	2009年12月30日	ワットレット	-	-	-	-	AAA	-	-	-	2004年12月29日
						第83優先受益権 (7-A7)	5.8	7ヶ月	2009年12月30日	ワットレット	-	-	-	-	AAA	-	-	-	2004年12月29日
						第84優先受益権 (7-A8)	5.8	8ヶ月	2009年12月30日	ワットレット	-	-	-	-	AAA	-	-	-	2004年12月29日
						第85優先受益権 (7-A9)	5.8	9ヶ月	2009年12月30日	ワットレット	-	-	-	-	AAA	-	-	-	2004年12月29日
						第86優先受益権 (7-A10)	5.5	10ヶ月	2009年12月30日	ワットレット	-	-	-	-	AAA	-	-	-	2004年12月29日
						第87優先受益権 (7-A11)	5.5	11ヶ月	2009年12月30日	ワットレット	-	-	-	-	AAA	-	-	-	2004年12月29日
						第88優先受益権 (7-A12)	5.6	12ヶ月	2009年12月30日	ワットレット	-	-	-	-	AAA	-	-	-	2004年12月29日
						第89優先受益権 (7-B1)	67	1年7ヶ月	2009年12月30日	コトールド・ 元金元金・ 元金元金	-	-	-	-	AAA	-	-	-	2004年12月29日
						第90優先受益権 (7-B2)	67	2年6ヶ月	2009年12月30日	コトールド・ 元金元金・ 元金元金	-	-	-	-	AAA	-	-	-	2004年12月29日
						第91優先受益権 (7-B3)	30	3年5ヶ月	2009年12月30日	コトールド・ 元金元金・ 元金元金	-	-	-	-	AAA	-	-	-	2004年12月29日
						第92優先受益権 (7-B4)	100	3年10ヶ月	2009年12月30日	コトールド・ 元金元金・ 元金元金	-	-	-	-	AAA	-	-	-	2004年12月29日
						第93優先受益権 (7-C1)	30	2ヶ月	2009年12月30日	1ヶ月毎 元金元金	-	-	-	-	AAA	-	-	-	2004年12月29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				
2004年12月30日 (2004年12月21日)	HC・リストラスト・シリーズ'12	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	114.8	-	2011年10月31日	コントロールド・アモortiゼーション	-	-	-	AAA	-	-	-	-	2004年12月30日
				信託受益権	信託受益権 (リース料債権)	優先受益権	33.6	-	2011年10月31日	1ヶ月毎 パースナル	-	-	-	AAA	-	-	-	-	2004年12月30日
				A B L	信託受益権 (リース料債権)	特定借入	32.2	-	2011年10月31日	コントロールド・アモortiゼーション	-	-	-	AAA	-	-	-	-	2004年12月30日
2004年12月30日 (2004年12月28日)	手形債権流動化プログラム 日発売受益権信託受益権 04-10-01(追加信託分)	日発売	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	3.53	2ヶ月	2005年3月2日	ハード・ブレット	-	-	-	a-1+	-	-	-	-	2004年12月30日
2004年12月30日 (2004年12月28日)	手形債権流動化プログラム 日発売受益権信託受益権 04-11-01(追加信託分)	日発売	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	6.61	3ヶ月	2005年4月4日	ハード・ブレット	-	-	-	a-1+	-	-	-	-	2004年12月30日
2004年12月30日 (2004年12月28日)	手形債権流動化プログラム 日発売受益権信託受益権 04-12-01	日発売	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	2.72	4ヶ月	2005年5月9日	ハード・ブレット	-	-	-	a-1+	-	-	-	-	2004年12月30日
2005年1月6日 (2004年12月20日)	貸付債権担保第26回 住宅金融公庫債券	住宅金融公庫	クレディ・スイスファースト・スト証券(事務幹事) ゴールドマン・サックス証券 UFJつばさ証券	国内公募債	住宅ローン債権	-	300	-	2040年1月10日	1ヶ月毎 パースナル	-	-	-	AAA	AAA	1.71%	0.31%	1.40% JGB265回	2004年12月20日
2005年1月13日 (2005年1月6日)	アン・ファンディング・ スリー・カンパニー・ リミテッド	日本信販	メリリチ日本証券 UFJつばさ証券	ユーロ債	信託受益権 (カードキャッシング債権 及びカードローン債権)	クラスA	698.2	-	2013年3月18日	1ヶ月毎 パースナル	AAA	-	Aaa	-	AAA	-	-	-	2005年1月13日
						クラスB	74.8	-	2013年3月18日	1ヶ月毎 パースナル	AA	-	Aa2	-	AA	-	-	-	2005年1月13日
						クラスC	56.2	-	2013年3月18日	1ヶ月毎 パースナル	A	-	A2	-	A	-	-	-	2005年1月13日
						クラスD	72.6	-	2013年3月18日	1ヶ月毎 パースナル	BBB	-	Baa2	-	BBB	-	-	-	2005年1月13日

以 上