

# 「証券化市場の動向調査」（2004年8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7月14日から8月12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 <sup>*</sup>	基準金利	基準日
											Fitch	JCR	Moody's	R&I	S&P				
2004年7月15日 (2004年7月13日)	(有)ヘルシア・ファンディング・コーポレーション(徳洲会)	医療法人徳洲会 及びグループ法人	野村信託銀行	信託受益権	診療報酬等債権	優先受益権	19.3	1.5ヶ月	2004年9月1日	ハード・ブレット	-	J-1+	-	-	-	-	-	-	2004年7月15日
2004年7月16日 (2004年7月12日)	第4回あおぎんリース リース料債権信託受益権	あおぎんリース	三菱証券 三菱信託銀行	信託受益権	リース料債権	優先受益権	23.2	2.03年	2010年8月27日	3ヶ月毎 コントロールド・ アモortiゼーション	-	-	-	AAA	-	-	-	-	2004年7月16日
2004年7月16日 (2004年7月13日)	Magnum Pleco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2月8日	ソフト・ブレット	-	-	Aaa	-	-	-	-	-	2004年7月30日
						A-2号優先受益権	15	0.50年	2010年2月8日	ソフト・ブレット	-	-	Aaa	-	-	-	-	-	2004年7月30日
						A-3号優先受益権	14	0.75年	2010年2月8日	ソフト・ブレット	-	-	Aaa	-	-	-	-	-	2004年7月30日
						A-4号優先受益権	14	1.00年	2010年2月8日	ソフト・ブレット	-	-	Aaa	-	-	-	-	-	2004年7月30日
						A-5号優先受益権	150	2.50年	2010年2月8日	コントロールド・ アモortiゼーション	-	-	Aaa	-	-	-	-	-	2004年7月30日
2004年7月20日 (2004年7月15日)	東リ・リック手形債権 信託受益権04-07	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	108日	2004年11月5日	ハード・ブレット	-	-	-	a-1+	-	-	-	-	2004年8月11日
2004年7月22日 (2004年7月8日)	エスエフ六本木開発 特定目的会社	-	大和証券SMB	国内私募債	商業用不動産	第4回A号	40	4.5年	2011年1月30日	ソフト・ブレット	-	AAA	Aaa	-	-	-	0.27%	6ヶ月 円LIBOR	2004年7月22日
2004年7月23日 (2004年7月20日)	ルミエール(2004-7)	株式会社オリエント コーポレーション	BNPパリバ証券会社東京支店 モルガン信託銀行	信託受益権	クレジット債権	優先受益権	125	1年1ヶ月 (加重平均年限)	2009年7月31日	1ヶ月毎 パースル	-	-	Aaa	-	AAA	-	-	-	2004年7月31日
2004年7月29日 (2004年7月20日)	シンセイ・ファンディング・ ケイマン・スリー	新生銀行	新生銀行	サムライ私募債	企業向け貸付債権	A	472	3.5年	2010年1月25日	ソフト・ブレット	AAA	-	Aaa	-	AAA	-	0.23%	3ヶ月 円LIBOR	2004年7月31日
2004年7月29日 (2004年7月20日)	シンセイ・ファンディング・ ケイマン・フォー	新生銀行	新生銀行	サムライ私募債	企業向け貸付債権	A	278	3.5年	2010年1月25日	ソフト・ブレット	AAA	-	Aaa	-	AAA	0.8119%	-	-	2004年7月31日
2004年7月29日 (2004年7月23日)	第2回百五リース リース料債権信託受益権	百五リース	三菱証券 三菱信託銀行	信託受益権	リース料債権	優先受益権	10	1.93年	2010年6月27日	3ヶ月毎 コントロールド・ アモortiゼーション	-	-	-	AAA	-	-	-	-	2004年7月29日
2004年7月29日 (2004年7月26日)	Progress Trust Certificate	昭和リース㈱	農中信託銀行	信託受益権	リース料債権	優先受益権	214.6	-	2012年2月27日	-	-	-	Aaa	-	-	-	-	-	2004年7月30日
2004年7月29日 (-)	日立キャピタル第5回 住宅ローン債権信託受益権	日立キャピタル 株式会社	モルガン・スタンレー 三菱信託銀行	信託受益権	住宅ローン債権	-	115	-	2039年9月10日	1ヶ月毎 パースル	-	-	-	-	AAA	-	-	-	2004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				
2004年7月30日 (2004年6月28日)	OTB住宅ローン債権 信託受益権No.2	オリックス信託銀行	オリックス信託銀行	A B L	信託受益権 (住宅ローン債権)	優先ローン	200	-	2030年1月	1ヶ月毎 元金均等返済	-	-	-	-	AAA	-	-	1ヶ月 円LIBOR	2004年7月30日
				信託受益権	住宅ローン債権	メザニン受益権	10	-	2030年1月	1ヶ月毎 元金均等返済	-	-	-	-	BBB	-	-	1ヶ月 円LIBOR	2004年7月30日
2004年7月30日 (2004年7月16日)	ブエノ信託	-	新生銀行	信託受益権	信託受益権 (住宅ローン債権)	A	120	-	2039年12月26日	1ヶ月毎 元金均等返済	-	-	-	-	AAA	-	-	-	2004年7月31日
2004年7月30日 (2004年7月26日)	BTM REAL 1st 2004-2	東京三菱銀行	三菱証券 三菱信託銀行	信託受益権	アパートローン債権	A	30	-	2036年2月26日	ソブレット	-	-	Aaa	-	-	-	-	-	2004年7月30日
						B	203	-	2036年2月26日	1ヶ月毎 元金均等返済	-	-	Aaa	-	-	-	-	-	2004年7月30日
2004年7月30日 (2004年7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 04-05-01 (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	3.16	2ヶ月	2004年10月4日	ハードレット	-	-	-	a-1+	-	-	-	-	2004年7月30日
2004年7月30日 (2004年7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 04-06-01 (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	5.17	3ヶ月	2004年11月4日	ハードレット	-	-	-	a-1+	-	-	-	-	2004年7月30日
2004年7月30日 (2004年7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 04-07-01	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	2.37	4ヶ月	2004年12月2日	ハードレット	-	-	-	a-1+	-	-	-	-	2004年7月30日
2004年7月30日 (-)	広域型保証CLO	七十七銀行、仙台銀行、 紀陽銀行、和歌山銀行、 きのくに信用金庫、 山陰合同銀行、 鳥取銀行、佐賀銀行、 商工組合中央金庫	商工中金 住友信託銀行	信託受益権	信託受益権 (企業向け貸付債権)	第一受益権	111	2.8年	2011年8月	コントロール・ アモortiゼーション	-	-	-	AAA	-	-	-	-	2004年7月30日
						第二受益権	59	-	2011年8月	6ヶ月毎 元金均等返済	-	-	-	AA-	-	-	-	-	2004年7月30日
2004年8月4日 (2004年7月21日)	貸付債権担保第21回 住宅金融公庫債券	住宅金融公庫	野村證券(事務主幹事) みずほ証券 ドイツ証券	国内公募債	住宅ローン債権	-	300	-	2039年8月10日	1ヶ月毎 元金均等返済	-	-	-	AAA	AAA	2.06%	0.27%	1.79% JGB261回債	2004年8月4日
2004年8月6日 (2004年8月4日)	-	昭和オート レンタリース	みずほコーポレート銀行	信託受益権 及び 資産担保ローン	メンテナンス特約付 オートリース料債権	優先受益権	5	-	2009年8月31日	3ヶ月毎 コントロール・ アモortiゼーション	-	-	-	AAA	-	-	-	-	2004年8月6日
						資産担保ローン	24.4	-	2009年8月31日	3ヶ月毎 コントロール・ アモortiゼーション	-	-	-	AAA	-	-	-	-	2004年8月6日
						メザニン 受益権	1	-	2009年8月31日	3ヶ月毎 コントロール・ アモortiゼーション	-	-	-	-	-	-	-	-	2004年8月6日
2004年8月9日 (2004年8月3日)	アン・ファンディング・ツアー	日本信販株式会社	メルリランチ日本証券 UFJつばさ証券	ユーロ債	信託受益権 (オートローン債権 及びショッピング クレジット債権)	A1号債	115	-	2010年4月18日	ソブレット	AAA	-	Aaa	-	AAA	-	-	-	2004年8月9日
						A2号債	80	-	2010年4月18日	ソブレット	AAA	-	Aaa	-	AAA	-	-	-	2004年8月9日
						A3号債	35	-	2010年4月18日	ソブレット	AAA	-	Aaa	-	AAA	-	-	-	2004年8月9日
						A4号債	270	-	2010年4月18日	1ヶ月毎 コントロール・ アモortiゼーション	AAA	-	Aaa	-	AAA	-	-	-	2004年8月9日
						A5号債	447.5	-	2010年4月18日	1ヶ月毎 元金均等返済	AAA	-	Aaa	-	AAA	-	-	-	2004年8月9日
						B号債	14.6	-	2010年4月18日	1ヶ月毎 元金均等返済	AA	-	Aa2	-	AA	-	-	-	2004年8月9日
						C号債	17.5	-	2010年4月18日	1ヶ月毎 元金均等返済	A	-	A2	-	A	-	-	-	2004年8月9日
						D号債	26.2	-	2010年4月18日	1ヶ月毎 元金均等返済	BBB	-	Baa2	-	BBB	-	-	-	2004年8月9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8月10日 (2004年7月26日)	第一生命 第2回 基金流動化特定目的会社	みずほコーポ レート銀行	みずほ証券	国内公募債	基金債権	A	200	5年	2011年8月	ハード・レット (注:繰延 条項あり)	A-	A	-	A	BBB	1.44%	—	—	2004年7月26日
						B	200	6年	2011年8月	ハード・レット (注:繰延 条項あり)	A-	A	-	A	BBB	1.77%	—	—	2004年7月26日
						C	200	7年	2011年8月	ハード・レット	A-	A	-	A	BBB	2.08%	—	—	2004年7月26日
2004年8月10日 ( - )	日立キャピタル 住宅ローン信託受益権	日立キャピタル 株式会社	-	-	-	-	-	-	2034年11月	-	-	-	-	-	AAA	-	-	-	2004年8月10日
2004年8月12日 ( - )	J M A C 2 信託	日本ジーエム エーシー・ コマーシャル・ モーゲージ 株式会社	クレディスイス ファーストボストン 証券会社東京支店	信託受益権	商業用不動産 担保ローン債権	A号	95	-	2011年5月	-	AAA	-	Aaa	-	-	-	-	-	2004年8月12日
						B号	13	-	2011年5月	-	AA	-	Aa2	-	-	-	-	-	2004年8月12日
						C号	12	-	2011年5月	-	A	-	A2	-	-	-	-	-	2004年8月12日
						D号	10	-	2011年5月	-	BBB	-	Baa2	-	-	-	-	-	2004年8月12日
						E号	8.7	-	2011年5月	-	BB	-	Ba2	-	-	-	-	-	2004年8月12日
						X1号 (O)	138.7 (想定元本)	-	-	-	AAA	-	Aaa	-	-	-	-	-	2004年8月12日

以 上