

## 「証券化市場の動向調査」(2005年9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、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、日本銀行が、2005年8月12日から9月13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				
2005年8月12日 (2005年8月5日)	九州ろうきん第1回住宅D-1債権 優先受益権	九州労働金庫	みずほ証券 みずほ信託銀行	信託受益権	住宅ローン債権	A-1	200	-	2039年1月31日	1ヶ月毎 パースル	-	-	Aaa	-	-	-	-	-	2005年8月12日
						A-2	243	-	2039年1月31日	1ヶ月毎 パースル	-	-	Aaa	-	-	-	-	-	2005年8月12日
2005年8月15日 (2005年8月3日)	住友生命基金流動化特定目的会社	大和証券SMBC	大和証券SMBC	国内公募債	基金債権 (住友生命宛て)	-	400	6年	2011年8月15日	ハード・ブレット	-	BBB+	-	BBB+	-	1.58%	-	-	2005年8月15日
2005年8月15日 (2005年8月8日)	NCL-CMBS 2005-1 信託	日興シティグループ証券	日興シティグループ証券	信託受益権	商業用不動産担保 ローン債権	A	116	2年	2011年8月2日	ソフト・ブレット	-	-	Aaa	-	-	-	-	-	2005年8月8日
						B	21	2年	2011年8月2日	ソフト・ブレット	-	-	Aa2	-	-	-	-	-	2005年8月8日
						C	21	2年	2011年8月2日	ソフト・ブレット	-	-	A2	-	-	-	-	-	2005年8月8日
						D	25	2年	2011年8月2日	ソフト・ブレット	-	-	Baa2	-	-	-	-	-	2005年8月8日
						E	24	2年	2011年8月2日	ソフト・ブレット	-	-	Ba2	-	-	-	-	-	2005年8月8日
						F	12	2年	2011年8月2日	ソフト・ブレット	-	-	Ba3	-	-	-	-	-	2005年8月8日
						X (IO)	219 (想定元本)	-	-	-	-	-	Aaa	-	-	-	-	-	2005年8月8日
2005年8月17日 (2005年8月4日)	インターメッツォ 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234回債)	A1	25	6.08年	2012年1月26日	ブレット	-	-	-	AAA	-	-	-	-	2005年8月17日
						A2	10	6.08年	2012年1月26日	ブレット	-	-	-	AAA	-	-	-	-	2005年8月17日
						B1	112	6.08年	2012年1月26日	ブレット	-	-	-	AA	-	-	-	-	2005年8月17日
						B2	7	6.08年	2012年1月26日	ブレット	-	-	-	AA	-	-	-	-	2005年8月17日
						C2	1	6.08年	2012年1月26日	ブレット	-	-	-	AA-	-	-	-	-	2005年8月17日
						D1	2	6.08年	2012年1月26日	ブレット	-	-	-	A	-	-	-	-	2005年8月17日
						D2	8	6.08年	2012年1月26日	ブレット	-	-	-	A	-	-	-	-	2005年8月17日
						E1	5	6.08年	2012年1月26日	ブレット	-	-	-	A-	-	-	-	-	2005年8月17日
						E2	25	6.08年	2012年1月26日	ブレット	-	-	-	A-	-	-	-	-	2005年8月17日
						F1	10	6.08年	2012年1月26日	ブレット	-	-	-	BBB	-	-	-	-	2005年8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	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8月22日 (2005年8月18日)	小口手形債権 一括流動化プログラム 優先受益権05-08-01-01	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	1.8	2ヶ月	2005年11月4日	ハード・ブレット	-	-	-	a-1+	-	-	-	-	2005年8月22日
2005年8月22日 (2005年8月18日)	小口手形債権 一括流動化プログラム 優先受益権05-08-01-02	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	3.3	3ヶ月	2005年12月5日	ハード・ブレット	-	-	-	a-1+	-	-	-	-	2005年8月22日
2005年8月22日 (2005年8月18日)	小口手形債権 一括流動化プログラム 優先受益権05-08-01-03	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	1.3	4ヶ月	2006年1月10日	ハード・ブレット	-	-	-	a-1+	-	-	-	-	2005年8月22日
2005年8月22日 (2005年8月18日)	東リ・リック 手形債権信託受益権05-08	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	105日	2005年12月5日	ハード・ブレット	-	-	-	a-1+	-	-	-	-	2005年9月13日
2005年8月23日 (2005年8月11日)	L-JAC LP 1 日本橋ホールディング 特定目的会社	-	リーマン・ブラザーズ	国内私募債	不動産信託受益権 及びその他資産	A号特定社債	510	-	2012年9月15日	物件売却に応じた シークエンシャル・ペイ	-	-	Aaa	-	AAA	-	-	3ヶ月 円LIBOR (初回のみ 4ヶ月 円LIBOR)	2005年8月19日
						B号特定社債	90	-	2012年9月15日	物件売却に応じた シークエンシャル・ペイ	-	-	Aa2	-	AA	-	-	3ヶ月 円LIBOR (初回のみ 4ヶ月 円LIBOR)	2005年8月19日
						C号特定社債	80	-	2012年9月15日	物件売却に応じた シークエンシャル・ペイ	-	-	A2	-	A	-	-	3ヶ月 円LIBOR (初回のみ 4ヶ月 円LIBOR)	2005年8月19日
						D号特定社債	30	-	2012年9月15日	物件売却に応じた シークエンシャル・ペイ	-	-	A3	-	A-	-	-	3ヶ月 円LIBOR (初回のみ 4ヶ月 円LIBOR)	2005年8月19日
2005年8月24日 (2005年8月10日)	株式会社ジャパンリテール	株式会社西武百貨店	野村証券 みずほ証券	国内私募債	商業用不動産	A	524	5年1ヶ月	2013年3月24日	ハード・ブレット	-	-	Aaa	-	-	-	-	-	2005年8月10日
						B	118	5年1ヶ月	2013年3月24日	ハード・ブレット	-	-	Aa2	-	-	-	-	-	2005年8月10日
						C	118	5年1ヶ月	2013年3月24日	ハード・ブレット	-	-	A2	-	-	-	-	-	2005年8月10日
2005年8月24日 (2005年8月17日)	NCBトラスト優先受益権	西日本シティ銀行	みずほ証券 みずほ信託銀行	信託受益権	住宅ローン債権	A-1	342	-	2039年4月30日	1ヶ月毎 パースナル	-	-	Aaa	-	-	-	-	-	2005年8月24日
						A-2	250	-	2039年4月30日	1ヶ月毎 パースナル	-	-	Aaa	-	-	-	-	-	2005年8月24日
						A-3	160	-	2039年4月30日	1ヶ月毎 パースナル	-	-	Aaa	-	-	-	-	-	2005年8月24日
2005年8月25日 (2005年8月12日)	日立キャピタル第7回 住宅ローン債権信託受益権	日立キャピタル株式会社	みずほ証券 三菱信託銀行	信託受益権	住宅ローン債権	優先受益権	175	-	2040年11月10日	1ヶ月毎 パースナル	-	-	-	-	AAA	-	-	-	2005年8月25日
2005年8月29日 (2005年8月23日)	第6回しがぎんリース・キャピタル リース料債権信託受益権	しがぎんリース・ キャピタル	三菱証券 しんきん信託銀行	信託受益権	リース料債権	優先受益権	15	2.14年	2011年8月27日	3ヶ月毎 コントロールド・ アフェクトーション	-	-	-	AAA	-	-	-	-	2005年8月29日
2005年8月30日 (2005年8月22日)	S M B C 第4回 住宅ローン信託受益権	三井住友銀行	大和証券 S M B C	信託受益権	住宅ローン債権	クラスA1	955	-	2042年7月31日	1ヶ月毎 パースナル	-	-	Aaa	-	AAA	0.96%	-	-	2005年8月30日
						クラスA2	860	-	2042年7月31日	1ヶ月毎 パースナル	-	-	Aaa	-	AAA	2.10%	-	-	2005年8月30日
2005年8月30日 (2005年8月26日)	第7回 共友リース リース料債権信託 優先受益権	共友リース	みずほ信託銀行 大垣共立銀行 (共同アレンジャー) 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	43.0	-	2012年9月27日	コントロールド・ アフェクトーション	-	AAA	-	-	-	-	-	-	2005年8月30日
2005年8月30日 ( - )	UHL2005-2信託受益権	UFJ銀行	UFJつばき証券 UFJ信託銀行	信託受益権	住宅ローン債権	クラスA	600	-	2041年5月27日	1ヶ月毎 パースナル	-	-	Aaa	-	-	-	-	-	2005年8月30日
						クラスB	400	-	2041年5月27日	1ヶ月毎 パースナル	-	-	Aaa	-	-	-	-	-	2005年8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				
2005年8月31日 (2005年8月24日)	UFJセントラル・リース・トラスト・シリーズ 9	UFJセントラル・リース	UFJセントラル・リース UFJ信託銀行	信託受益権	リース料債権	第139優先受益権 (9-A1) ～ 第150優先受益権 (9-A12)	98	1ヶ月～ 12ヶ月	2010年8月31日	ソフト・レット	-	-	-	-	AAA	-	-	-	2005年8月31日
						第151優先受益権 (9-B1)	163	2年1ヶ月	2010年8月31日	コントロールド・ アフェクトーション	-	-	-	-	AAA	-	-	-	2005年8月31日
						第152優先受益権 (9-B2)	110	4年2ヶ月	2010年8月31日	コントロールド・ アフェクトーション	-	-	-	-	AAA	-	-	-	2005年8月31日
						第153優先受益権 (9-C1)	70	2ヶ月	2010年8月31日	1ヶ月毎 パースナル	-	-	-	-	AAA	-	-	-	2005年8月31日
2005年8月31日 (2005年8月24日)	HC・リース・トラスト・シリーズ 15	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	72	-	2012年6月29日	コントロールド・ アフェクトーション	-	-	-	AAA	-	-	-	-	2005年8月31日
				信託受益権	信託受益権 (リース料債権)	優先受益権	20.5	-	2012年6月29日	1ヶ月毎 パースナル	-	-	-	AAA	-	-	-	-	2005年8月31日
				A B L	信託受益権 (リース料債権)	特定借入	28	-	2012年6月29日	コントロールド・ アフェクトーション	-	-	-	AAA	-	-	-	-	2005年8月31日
2005年8月31日 (2005年8月25日)	第1回香川銀リース・リース料債権信託受益権	香川銀リース	三菱証券 しんきん信託銀行	信託受益権	リース料債権	優先受益権	15	2.08年	2011年9月27日	3ヶ月毎 コントロールド・ アフェクトーション	-	-	-	AAA	-	-	-	-	2005年8月31日
2005年8月31日 (2005年8月29日)	手形債権流動化プログラム 日発売受益権信託受益権 05-06-01	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	3.0	2ヶ月	2005年11月2日	ハード・レット	-	-	-	a-1+	-	-	-	-	2005年8月31日
2005年8月31日 (2005年8月29日)	手形債権流動化プログラム 日発売受益権信託受益権 05-07-01	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	6.0	3ヶ月	2005年12月2日	ハード・レット	-	-	-	a-1+	-	-	-	-	2005年8月31日
2005年8月31日 (2005年8月29日)	手形債権流動化プログラム 日発売受益権信託受益権 05-08-01	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	2.6	4ヶ月	2006年1月6日	ハード・レット	-	-	-	a-1+	-	-	-	-	2005年8月31日
2005年8月31日 ( - )	BTM第1回住宅ローン信託受益権	東京三菱銀行	三菱証券 三菱信託銀行	信託受益権	住宅ローン債権	A	50	-	2042年6月26日	コントロールド・ アフェクトーション	-	-	Aaa	-	-	-	-	-	2005年8月31日
						B	421	-	2042年6月26日	1ヶ月毎 パースナル	-	-	Aaa	-	-	-	-	-	2005年8月31日
2005年9月5日 (2005年8月22日)	貸付債権担保第34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・シティ証券(事務幹事) 三菱証券 モガン・スタンレー証券	国内公募債	住宅ローン債権	-	580	-	2040年9月10日	1ヶ月毎 パースナル	-	-	-	AAA	AAA	1.82%	0.39%	1.43% JGB270回債	2005年8月22日
2005年9月5日 (2005年8月25日)	中央三井信託銀行 第2回不動産ノリクス・ローン債権 信託受益権	中央三井信託銀行 株式会社	日興シティグループ証券	信託受益権	商業用不動産担保 ローン債権	A	155	3年6ヶ月	2011年3月1日	ソフト・レット	-	-	Aaa	-	-	-	-	-	2005年8月25日
						X (IO)	155 (想定元本)	-	-	-	-	-	Aaa	-	-	-	-	-	2005年8月25日
2005年9月5日 ( - )	NRF Trust 2005-4	-	-	-	住宅ローン債権	1号	98	-	2040年9月15日	-	-	-	-	-	AAA	-	-	-	2005年9月5日
						2号	98	-	2040年9月15日	-	-	-	-	-	AAA	-	-	-	2005年9月5日

以上