

「証券化市場の動向調査」（2005年7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6月14日から7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 <sup>1)</sup>	基準金利	基準日
											Fitch	JCR	Moody's	R&I	S&P				
2004年7月9日 (2004年7月2日)	全日信販 カードローン債権信託	全日信販株	あおぞら銀行	信託受益権	カードローン債権	A号優先受益権	-	-	-	-	-	-	-	-	AAA	-	-	-	2005年7月13日
						B号優先受益権	-	-	-	-	-	-	-	-	A	-	-	-	2005年7月13日
2005年6月17日 (2005年6月9日)	JPM-JC8	JPモルガン・チェース銀行 J.P.モルガン証券会社	J.P.モルガン証券会社 モルガン信託銀行	信託受益権	商業用不動産担保 ローン債権	A	225	3.9年	2013年4月26日	アコントロールド・ アモortiゼーション	-	-	Aaa	-	AAA	-	-	-	2005年6月17日
						B	30	4.8年	2013年4月26日	アコントロールド・ アモortiゼーション	-	-	Aa2	-	AA	-	-	-	2005年6月17日
						C	20	4.6年	2013年4月26日	アコントロールド・ アモortiゼーション	-	-	A2	-	A	-	-	-	2005年6月17日
						D	15	4.6年	2013年4月26日	アコントロールド・ アモortiゼーション	-	-	Baa2	-	BBB	-	-	-	2005年6月17日
						E	3	4.6年	2013年4月26日	アコントロールド・ アモortiゼーション	-	-	Baa3	-	BBB-	-	-	-	2005年6月17日
						F	4	4.6年	2013年4月26日	アコントロールド・ アモortiゼーション	-	-	Ba2	-	BB	-	-	-	2005年6月17日
						X	297 (想定元本)	4.6年	2013年4月26日	アコントロールド・ アモortiゼーション	-	-	Aaa	-	AAA	-	-	-	2005年6月17日
2005年6月17日 (2005年6月10日)	RCCトラスト-VI	RCC リーマン関連会社	リーマン・ブラザーズ	信託受益権	企業向け貸付債権 (不良債権、一部 正常債権)	第一受益権	98	-	2011年5月27日	1ヶ月毎 パースナル	-	-	Aaa	-	AAA	-	-	1MLIBOR	2005年6月17日
						第二受益権	23	-	2011年5月27日	1ヶ月毎 パースナル	-	-	Aa2	-	AA	-	-	1MLIBOR	2005年6月17日
						第三受益権	20	-	2011年5月27日	1ヶ月毎 パースナル	-	-	A2	-	A	-	-	1MLIBOR	2005年6月17日
						第四受益権	20	-	2011年5月27日	1ヶ月毎 パースナル	-	-	Baa2	-	BBB	-	-	1MLIBOR	2005年6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	Moodys	R&I	S&P				
2005年6月20日 (2005年6月16日)	小口手形債権 一括流動化ﾌﾟﾛｸﾞﾗﾑ 優先受益権 05-06-01-01	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	2.2	2ヶ月	2005年9月5日	ハードﾌﾟﾚｯﾄ	-	-	-	a-1+	-	-	-	-	2005年6月30日
2005年6月20日 (2005年6月16日)	小口手形債権 一括流動化ﾌﾟﾛｸﾞﾗﾑ 優先受益権 05-06-01-02	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	3.0	3ヶ月	2005年10月5日	ハードﾌﾟﾚｯﾄ	-	-	-	a-1+	-	-	-	-	2005年6月30日
2005年6月20日 (2005年6月16日)	小口手形債権 一括流動化ﾌﾟﾛｸﾞﾗﾑ 優先受益権 05-06-01-03	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	1.6	4ヶ月	2005年11月4日	ハードﾌﾟﾚｯﾄ	-	-	-	a-1+	-	-	-	-	2005年6月30日
2005年6月20日 (2005年6月16日)	東リ・リック 手形債権信託受益権05-06	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	9	107日	2005年10月5日	ハードﾌﾟﾚｯﾄ	-	-	-	a-1+	-	-	-	-	2005年7月13日
2005年6月27日 (2005年6月16日)	中央三井信託銀行株式会社 第6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) 三井住友信託銀行(受託者)	信託受益権	住宅ローン債権	クラスA1 優先受益権	400	-	2042年2月13日	1ヶ月毎 ﾊﾞｽﾚｰ	-	-	Aaa	-	-	-	-	-	2005年6月27日
						クラスA2 優先受益権	400	-	2042年2月13日	1ヶ月毎 ﾊﾞｽﾚｰ	-	-	Aaa	-	-	-	-	-	2005年6月27日
2005年6月27日 (2005年6月20日)	りそな&RCC プランニング-I	りそな銀行他	リーマン・ブラザーズ	信託受益権	企業向け貸付債権 (不良債権、一部 正常債権)	第一受益権	31	-	2010年5月27日	1ヶ月毎 ﾊﾞｽﾚｰ	-	-	-	-	AAA	-	-	1MLIBOR	2005年6月27日
						第二受益権	6	-	2010年5月27日	1ヶ月毎 ﾊﾞｽﾚｰ	-	-	-	-	AA	-	-	1MLIBOR	2005年6月27日
						第三受益権	6	-	2010年5月27日	1ヶ月毎 ﾊﾞｽﾚｰ	-	-	-	-	A	-	-	1MLIBOR	2005年6月27日
						第四受益権	7	-	2010年5月27日	1ヶ月毎 ﾊﾞｽﾚｰ	-	-	-	-	BBB	-	-	1MLIBOR	2005年6月27日
2005年6月29日 (2005年6月24日)	全日信販 第2回カードローン債権信託	全日信販㈱	あおぞら銀行	信託受益権	カードローン債権	A号優先受益権	-	-	-	-	-	-	-	-	AAA	-	-	-	2005年7月13日
						B号優先受益権	-	-	-	-	-	-	-	-	A	-	-	-	2005年7月13日
2005年6月29日 (2005年6月24日)	MLD TRUST Series-27	三井リース事業株式会社	中央三井信託銀行 野村證券 三井アセット信託銀行(受託者)	信託受益権	リース料債権	優先受益権	250	2.04年	2012年7月23日	1ヶ月毎 ｺﾝﾄﾘﾊﾞｰﾄﾞ・ ﾌｧﾁﾍﾞｰｼｮﾝ	-	-	-	AAA	-	-	-	-	2005年6月29日
2005年6月29日 (-)	ORIX-NRL信託 信託受益権	オリックス株式会社	オリックス株式会社	信託受益権	商業用不動産担保 ローン債権	A号受益権	214	3.95年	2012年3月8日	3ヶ月毎 ﾊﾞｽﾚｰ	-	-	Aaa	-	AAA	-	-	-	2005年7月1日
						B号受益権	31	4.69年	2012年3月8日	3ヶ月毎 ﾊﾞｽﾚｰ	-	-	Aa2	-	AA	-	-	-	2005年7月1日
						C号受益権	31	4.69年	2012年3月8日	3ヶ月毎 ﾊﾞｽﾚｰ	-	-	A2	-	A	-	-	-	2005年7月1日
						D号受益権	24	4.69年	2012年3月8日	3ヶ月毎 ﾊﾞｽﾚｰ	-	-	Baa2	-	BBB	-	-	-	2005年7月1日
						X号受益権 (IO)	300 (想定元本)	4.16年	2012年3月8日	3ヶ月毎 ﾊﾞｽﾚｰ	-	-	Aaa	-	AAA	-	-	-	2005年7月1日
2005年6月30日 (2005年6月14日)	株式会社第2回わかば	中小企業金融公庫	(私募の取扱者) みずほ証券 野村證券	国内私募債	CDS(中小企業が発行する 私募債)・預金	A号	178	2.91年	2010年11月24日	初回を2006年8月 23日とし、以降 毎年8月及び11月に 順次償還	-	-	Aaa	AAA	-	-	0.17%	3ヶ月 TIBOR (初回は 5ヶ月 TIBOR)	2005年6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6月30日 (2005年6月17日)	ブライムクリスト・スリー株式会社 第1回無担保社債	-	大和証券SMB	国内私募債	信託受益権 (商業用不動産)	A-1号社債	170	-	2014年7月25日	コントロールド・ アフェイゼーション	-	AAA	Aaa	-	-	-	-	-	2005年6月30日
						A-2号社債	295	-	2014年7月25日	コントロールド・ アフェイゼーション	-	AAA	Aaa	-	-	-	-	-	2005年6月30日
						B-1号社債	22	-	2014年7月25日	ソフトブレット	-	AA	Aa2	-	-	-	-	-	2005年6月30日
						B-2号社債	57	-	2014年7月25日	ソフトブレット	-	AA	Aa2	-	-	-	-	-	2005年6月30日
						C-1号社債	7	-	2014年7月25日	ソフトブレット	-	A	A2	-	-	-	-	-	2005年6月30日
						C-2号社債	71	-	2014年7月25日	ソフトブレット	-	A	A2	-	-	-	-	-	2005年6月30日
2005年6月30日 (2005年6月17日)	ブライムクリスト・フォー株式会社 第1回無担保社債	-	大和証券SMB	国内私募債	信託受益権 (商業用不動産)	A-1号社債	10	-	2014年7月25日	コントロールド・ アフェイゼーション	-	AAA	Aaa	-	-	-	-	-	2005年6月30日
						A-2号社債	300	-	2014年7月25日	コントロールド・ アフェイゼーション	-	AAA	Aaa	-	-	-	-	-	2005年6月30日
						B号社債	53	-	2014年7月25日	ソフトブレット	-	AA	Aa2	-	-	-	-	-	2005年6月30日
						C号社債	52	-	2014年7月25日	ソフトブレット	-	A	A2	-	-	-	-	-	2005年6月30日
2005年6月30日 (2005年6月22日)	ハイドラ・ファイブ・ ファンディング・コーポレーション	新生銀行	新生銀行	サムライ私募債	信託受益権 (住宅ローン債権)	S1号	703	4.8年	2045年7月18日	1ヶ月毎 ハスル	AAA	-	Aaa	-	AAA	-	0.20%	1MLibor	2005年6月30日
						S2号	134	5.8年	2045年7月18日	1ヶ月毎 ハスル	AAA	-	Aaa	-	AAA	1.27%	-	-	2005年6月30日
2005年6月30日 (2005年6月24日)	HC-リストラスト シリーズ14	日立キャピタル	日立キャピタル みずほ信託銀行	信託受益権	信託受益権 (リース料債権)	優先受益権	100.3	-	2012年4月27日	コントロールド・ アフェイゼーション	-	-	-	AAA	-	-	-	-	2005年6月30日
				信託受益権	信託受益権 (リース料債権)	優先受益権	62.1	-	2012年4月27日	1ヶ月毎 ハスル	-	-	-	AAA	-	-	-	-	2005年6月30日
				A B L	信託受益権 (リース料債権)	特定借入	75.7	-	2012年4月27日	コントロールド・ アフェイゼーション	-	-	-	AAA	-	-	-	-	2005年6月30日
2005年6月30日 (2005年6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 05-04-01	日発売売	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	3.8	2ヶ月	2005年9月2日	ハードブレット	-	-	-	a-1+	-	-	-	-	2005年6月30日
2005年6月30日 (2005年6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 05-05-01	日発売売	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	5.9	3ヶ月	2005年10月4日	ハードブレット	-	-	-	a-1+	-	-	-	-	2005年6月30日
2005年6月30日 (2005年6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 05-06-01	日発売売	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	2.8	4ヶ月	2005年11月2日	ハードブレット	-	-	-	a-1+	-	-	-	-	2005年6月30日
2005年6月30日 (-)	日立キャピタル リース料債権信託 優先受益権	日立キャピタル	みずほ信託銀行	信託受益権	リース料債権	優先受益権	158.6	-	2017年8月31日	1ヶ月毎 ハスル	-	-	-	AAA	-	-	-	-	2005年6月30日
2005年6月30日 (-)	-	-	住友信託銀行	信託受益権	リース料債権	優先受益権	58	2年	2010年6月30日	コントロールド・ アフェイゼーション および 期日一括償還	-	-	-	AAA	-	-	-	-	2005年7月13日
2005年6月30日 (-)	-	-	北海道銀行 住友信託銀行	信託受益権	手形債権	優先受益権	0.47	4ヶ月	2005年10月24日	ハードブレット	-	J-1	-	-	-	-	-	-	2005年7月13日
				A B L	手形債権	優先受益権	5.5	2ヶ月	2005年10月24日	コントロールド・ アフェイゼーション	-	J-1	-	-	-	-	-	-	2005年7月13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7月5日 (2005年6月20日)	貸付債権担保第32回 住宅金融公庫債券	住宅金融公庫	日興シティグループ証券 (事務幹事) UFJつばさ証券 ドイツ証券	国内公募債	住宅ローン債権	-	420	-	2040年7月10日	1ヶ月毎 パースル	-	-	-	AAA	AAA	1.69%	0.39%	1.30% JGB270回債	2005年6月20日
2005年7月5日 ( - )	NRF Trust 2005-2	-	-	-	住宅ローン債権	1号	75	-	2040年7月	-	-	-	-	-	AAA	-	-	-	2005年7月5日
						2号	75	-	2040年7月	-	-	-	-	-	AAA	-	-	-	2005年7月5日
2005年7月7日 (2005年6月30日)	トライアングル・モーゲージ・トラスト	みずほ証券	みずほ証券	信託受益権	信託受益権 (住宅ローン債権)	A号受益権	765	5.9年	2041年9月30日	1ヶ月毎 パースル	-	-	Aaa	-	-	-	-	-	2005年7月7日
				A B L	信託受益権 (住宅ローン債権)	B号ABL	150	7.58年	2041年9月30日	1ヶ月毎 パースル	-	-	Aaa	-	-	-	-	-	2005年7月7日
				信託受益権	信託受益権 (住宅ローン債権)	C号受益権	350	17.91年	2041年9月30日	1ヶ月毎 パースル	-	-	Aaa	-	-	-	-	-	2005年7月7日

以 上