

「証券化市場の動向調査」（2005年10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9月14日から10月14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9月16日 （2005年9月13日）	QueenAngel トラストファンディング	芙蓉総合リース 株式会社	みずほ信託銀行	信託受益権	リース料債権	A-1号～A-4号 優先受益権	42	-	2006年8月31日	ソトブレット	-	-	-	AAA	-	-	-	-	2005年9月30日
						A-5号 優先受益権	89	-	2009年5月29日	コントロールド・ アフィリエイト	-	-	-	AAA	-	-	-	-	2005年9月30日
						B号 優先受益権	30	-	2010年11月30日	3ヶ月毎 パースル	-	-	-	AAA	-	-	-	-	2005年9月30日
2005年9月20日 （2005年9月15日）	小口手形債権 一括流動化プログラム 優先受益権05-09-01-01	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	2.9	2ヶ月	2005年12月5日	ハードブレット	-	-	-	a-1	-	-	-	-	2005年9月20日
2005年9月20日 （2005年9月15日）	小口手形債権 一括流動化プログラム 優先受益権05-09-01-02	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	2006年1月10日	ハードブレット	-	-	-	a-1	-	-	-	-	2005年9月20日
2005年9月20日 （2005年9月15日）	小口手形債権 一括流動化プログラム 優先受益権05-09-01-03	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	1.2	4ヶ月	2006年2月3日	ハードブレット	-	-	-	a-1	-	-	-	-	2005年9月20日
2005年9月20日 （2005年9月15日）	ヤンマーククレジットサービス 第六回割賦債権信託受益権	ヤンマーククレジット サービス株式会社	みずほコーポレート銀行	信託受益権	クレジット債権	-	33.3	-	2010年12月20日	コントロールド・ アフィリエイト	-	-	-	AAA	-	-	-	-	2005年9月20日
2005年9月20日 （2005年9月15日）	東リ・リック 手形債権信託受益権05-09	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	112日	2006年1月10日	ハードブレット	-	-	-	a-1+	-	-	-	-	2005年10月11日
2005年9月21日 （2005年9月13日）	J-CORE7	-	ドイツ証券会社東京支店 UFJ 三菱証券株式会社	信託受益権	不動産担保付貸付債権	A号	186	-	2012年7月27日	-	-	-	Aaa	-	-	-	-	-	2005年9月21日
						B号	15	-	2012年7月27日	-	-	-	Aa2	-	-	-	-	-	2005年9月21日
						C号	17	-	2012年7月27日	-	-	-	A2	-	-	-	-	-	2005年9月21日
						D号	15	-	2012年7月27日	-	-	-	Baa2	-	-	-	-	-	2005年9月21日
						X-1号	89 （想定元本）	-	2012年7月27日	-	-	-	Aaa	-	-	-	-	-	2005年9月21日
						X-2号	144 （想定元本）	-	2012年7月27日	-	-	-	Aaa	-	-	-	-	-	2005年9月21日
2005年9月22日 （2005年9月15日）	第2回日本包装リース リース料債権信託受益権	日本包装リース	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	2.35年	2011年9月27日	3ヶ月毎 コントロールド・ アフィリエイト	-	-	-	AAA	-	-	-	-	2005年9月22日
2005年9月22日 （2005年9月20日）	ルミエール（2005-9）	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	127	12ヶ月 （加重平均年限）	2010年9月30日	1ヶ月毎 パースル	-	-	Aaa	-	AAA	-	-	-	2005年9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9月27日 (2005年9月5日)	Pisces Finance Limited 2005-01	Pisces Finance Limited	Goldman Sachs International	ユーロ債	CDS	-	50	-	2010年9月27日	-	-	-	Aa2	-	-	-	-	3ヶ月円 LIBOR	2005年10月12日
2005年9月28日 (2005年9月15日)	-	-	UFJつばさ証券株式会社	サムライ私募債	企業向け貸付債権	-	120	5年	2015年9月10日	ソブレット	-	-	-	-	-	-	-	-	2005年9月28日
2005年9月28日 (2005年9月26日)	㈱キムラ手形債権信託受益権・ ABL05-09	㈱キムラ	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	0.2	4ヶ月	2006年1月17日	ハードブレット	-	J-1	-	-	-	-	-	-	2005年10月14日
				ABL	手形債権	優先受益権	8.2	2ヶ月	2006年1月17日	コントロール・ アフェクトーション	-	J-1	-	-	-	-	-	-	2005年10月14日
2005年9月28日 (-)	西日本総合リース 第5回リース料債権信託	西日本総合リース	三菱信託銀行	信託受益権	リース料債権	優先受益権	54.6	5年	2014年6月28日	コントロール・ アフェクトーション	-	-	-	AAA	-	-	-	-	2005年9月28日
2005年9月28日 (-)	アフィニティ信託優先受益権	-	-	-	-	Senior	654	-	2042年7月	-	-	-	-	-	AAA	-	-	-	2005年9月28日
2005年9月29日 (2005年9月14日)	貸付債権担保3種第2回 住宅金融公庫債券	住宅金融公庫	ゴールドマン・サックス 証券会社東京支店 (事務主幹事) 日興シティグループ証券株式会社 みずほ証券株式会社	国内公募債	住宅ローン債権	-	2,500	-	2036年5月10日	1ヶ月毎 バースル	-	-	-	AAA	AAA	1.61%	0.64%	0.97% JGB244回債	2005年10月12日
2005年9月29日 (2005年9月15日)	中央三井信託銀行株式会社 第7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) 日興シティグループ証券(共同主幹事) 三井アセット信託銀行(受託者)	信託受益権	住宅ローン債権	クASA1 優先受益権	420	-	2042年5月7日	1ヶ月毎 バースル	-	-	Aaa	-	-	-	-	-	2005年9月29日
						クASA2 優先受益権	400	-	2042年5月7日	1ヶ月毎 バースル	-	-	Aaa	-	-	-	-	-	2005年9月29日
2005年9月29日 (2005年9月22日)	北海道リース 第3回リース料債権信託	北海道リース 株式会社	みずほ信託銀行	信託受益権	リース料債権	優先受益権	23	-	2010年10月29日	コントロール・ アフェクトーション	-	AAA	-	-	-	-	-	-	2005年9月30日
2005年9月29日 (-)	JCOM 2005-2 信託受益権	-	-	-	住宅ローン債権	1号	79	-	2036年5月	-	-	-	-	-	AAA	-	-	-	2005年9月29日
						2号	53	-	2036年5月	-	-	-	-	-	AAA	-	-	-	2005年9月29日
2005年9月30日 (2005年9月20日)	シナジー・ツー・ファンディング 優先受益権	新生銀行	新生銀行	信託受益権	証券化商品 (CMBS等)	A	407	4.3年	2038年10月15日	3ヶ月毎 バースル	AAA	-	-	-	AAA	-	0.25%	3ヶ月円 LIBOR	2005年10月12日
						B	25	4.5年	2038年10月15日	3ヶ月毎 バースル	AA	-	-	-	AA	-	0.35%	3ヶ月円 LIBOR	2005年10月12日
						C	18	4.8年	2038年10月15日	3ヶ月毎 バースル	A	-	-	-	A	-	0.65%	3ヶ月円 LIBOR	2005年10月12日
						D	18	5.0年	2038年10月15日	3ヶ月毎 バースル	BBB	-	-	-	BBB	-	1.30%	3ヶ月円 LIBOR	2005年10月12日
						E	19	5.0年	2038年10月15日	3ヶ月毎 バースル	BB	-	-	-	BB	-	3.50%	3ヶ月円 LIBOR	2005年10月12日
2005年9月30日 (2005年9月28日)	手形債権流動化プログラム 日発販売受益権信託受益権 05-07-01	日発販売	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	2.7	2ヶ月	2005年12月2日	ハードブレット	-	-	-	a-1+	-	-	-	-	2005年9月30日
2005年9月30日 (2005年9月28日)	手形債権流動化プログラム 日発販売受益権信託受益権 05-08-01	日発販売	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	5.7	3ヶ月	2006年1月6日	ハードブレット	-	-	-	a-1+	-	-	-	-	2005年9月30日
2005年9月30日 (2005年9月28日)	手形債権流動化プログラム 日発販売受益権信託受益権 05-09-01	日発販売	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	2.9	4ヶ月	2006年2月2日	ハードブレット	-	-	-	a-1+	-	-	-	-	2005年9月30日
2005年10月5日 (2005年9月20日)	貸付債権担保第35回 住宅金融公庫債券	住宅金融公庫	ゴールドマン・サックス 証券会社東京支店 (事務主幹事) 日興シティグループ証券株式会社 みずほ証券株式会社	国内公募債	住宅ローン債権	-	849	-	2040年10月10日	1ヶ月毎 バースル	-	-	-	AAA	AAA	1.79%	0.40%	1.39% JGB272回債	2005年10月12日
2005年10月5日 (-)	NRF Trust 2005-5	-	-	-	住宅ローン債権	1号	95	-	2040年10月	-	-	-	-	-	AAA	-	-	-	2005年10月5日
						2号	95	-	2040年10月	-	-	-	-	-	AAA	-	-	-	2005年10月5日
2005年10月12日 (2005年9月28日)	オクターブ・リミテッド	-	Mizuho International plc	ユーロ債	CDS契約、 金利スワップ契約、 日本国債	シリーズ2	30	5.2年	2011年4月26日	ブレット	-	A-	-	-	-	-	-	-	2005年10月12日