

「証券化市場の動向調査」（2006年7月公表分）（注）

【本資料を御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、日本証券業協会及び全国銀行協会として、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、日本証券業協会及び全国銀行協会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、日本証券業協会及び全国銀行協会として、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係る情報は、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、日本証券業協会及び全国銀行協会が、2006年6月14日から2006年7月13日まで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				
2006年6月14日 (2006年6月9日)	トーカタ東千田特定目的会社	株式会社トーカタ	広島銀行	国内私募債	商業用不動産	第1回特定社債	18	—	2009年8月28日	ワットレット	—	A	—	—	—	—	—	—	2006年6月14日
				ABL		第1回特定目的 借入れ(甲号)	17	—	2009年8月28日	ワットレット	—	A	—	—	—	—	—	—	2006年6月14日
				ABL		第1回特定目的 借入れ(乙号)	3	—	2009年8月28日	ワットレット	—	BBB	—	—	—	—	—	—	2006年6月14日
2006年6月16日 (2006年6月7日)	SMBC第7回住宅ローン信託受益権	三井住友銀行	大和証券SMBC	信託受益権	住宅ローン債権	クラスA1 信託受益権	440	—	2043年2月28日	1ヶ月毎 バスル	—	—	Aaa	—	AAA	1.46%	—	—	2006年6月16日
						クラスA2 信託受益権	925	—	2043年2月28日	1ヶ月毎 バスル	—	—	Aaa	—	AAA	2.53%	—	—	2006年6月16日
2006年6月20日 (2006年6月5日)	アルベジオ・リミテッド シリーズ8	—	Mizuho International plc	ユーロ債	日本企業100社を参照 プログラムとするCDS契約、 金利スワップ契約に基づく 発行体の権利及び担保債 (第231回国債)	—	50	5.16年	2011年8月24日	ブレット	—	—	—	A	—	—	—	—	2006年6月20日
2006年6月20日 (2006年6月15日)	光BB事業証券化 第1回信託受益権	株式会社UCOM	日興証券グループ証券	信託受益権	—	—	200	10年/5.5年	2021年6月30日	コントロールド・ アフィリエイト	—	—	A2	—	A	—	—	—	2006年6月15日
2006年6月20日 (2006年6月16日)	小口手形債権 一括流動化プログラム 優先受益権 06-06-01-01	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	3.0	2.5ヶ月	2006年9月5日	ハードブレット	—	—	—	a-1	—	—	—	—	2006年6月20日
2006年6月20日 (2006年6月16日)	小口手形債権 一括流動化プログラム 優先受益権 06-06-01-02	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	3.5ヶ月	2006年10月5日	ハードブレット	—	—	—	a-1	—	—	—	—	2006年6月20日
2006年6月20日 (2006年6月16日)	小口手形債権 一括流動化プログラム 優先受益権 06-06-01-03	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	4.5ヶ月	2006年11月6日	ハードブレット	—	—	—	a-1	—	—	—	—	2006年6月20日
2006年6月20日 (2006年6月16日)	東リ・リック手形債権 信託受益権06-06	東リ(株)・ リック(株)	三菱UFJ信託銀行	信託受益権	商業手形	優先受益権	9	107日	2006年10月5日	ハードブレット	—	—	—	a-1+	—	—	—	—	2006年7月6日
2006年6月23日 (2006年6月20日)	ルミエール(2006-6)	株式会社オリエント ユーボレーション	BNPパリバ証券会社東京支店 JP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	11ヶ月 (加重平均年限)	2011年6月30日	1ヶ月毎 バスル	—	—	Aaa	—	AAA	—	—	—	2006年7月6日
2006年6月23日 (—)	オリックスローントラスト (保証型)	オリックス	オリックス	信託受益権	信託受益権	A号	455	2.5年	2041年9月25日	1ヶ月毎 バスル	—	—	Aaa	AAA	AAA	変動	—	—	2006年6月23日
						B号	76	6.2年	2041年9月25日	1ヶ月毎 バスル	—	—	Aa2	AA	AA	変動	—	—	2006年6月23日
						C号	114	8.3年	2041年9月25日	1ヶ月毎 バスル	—	—	A2	A	A	変動	—	—	2006年6月23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
											Fitc	JCR	Moody's	R&I	S&P				
2006年6月26日 (2006年6月19日)	第4回楽天KC マネーカード・トラスト	楽天KC株式会社	みずほ証券 オリックス信託銀行	信託受益権	カードローン債権	A号優先受益権	48	3.33年	2014年6月18日	2年後から 3ヶ月毎 バスル	—	—	Aaa	—	—	—	—	—	2006年7月11日
						B号優先受益権	12	3.33年	2014年6月18日	2年後から 3ヶ月毎 バスル	—	—	Baa2	—	—	—	—	—	2006年7月11日
2006年6月26日 (2006年6月19日)	第4回楽天KCカード・トラスト	楽天KC株式会社	みずほ証券 オリックス信託銀行	信託受益権	カードローン債権	A号優先受益権	88	3.33年	2014年6月18日	2年後から 3ヶ月毎 バスル	—	—	Aaa	—	—	—	—	—	2006年7月11日
						B号優先受益権	22	3.33年	2014年6月18日	2年後から 3ヶ月毎 バスル	—	—	Baa2	—	—	—	—	—	2006年7月11日
2006年6月26日 (2006年6月22日)	MSNW Trust Certificate Series 06060	ディカシムネットワークの 100%孫会社	農中信託銀行	信託受益権	調剤報酬債権	優先受益権	9.7	40日程度	2006年8月2日	ハード・ブレット	—	J-1+	—	—	—	—	—	—	2006年7月7日
2006年6月28日 (2006年6月14日)	アルベジオ・リミテッド シリーズ9	—	Mizuho International plc	ユーロ債	日本企業100社を参照 グループとするCDS契 約、金利スワップ 契約 に基づく発行体の権 利及び担保債(第231 回国債)	—	50	5.33年	2011年10月24日	ブレット	—	—	—	A	—	—	—	—	2006年6月28日
2006年6月29日 (2006年6月20日)	クレア・テン特定目的会社	株式会社オリエント 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	269	2.1年	2012年4月14日	1年後から 1ヶ月毎 コントロール・ アフィリエイト	—	—	Aaa	—	AAA	—	—	—	2006年6月29日
						B	29	2.1年	2012年4月14日	1年後から 1ヶ月毎 コントロール・ アフィリエイト	—	—	A2	—	A	—	—	—	2006年6月29日
						C	22	2.1年	2012年4月14日	1年後から 1ヶ月毎 コントロール・ アフィリエイト	—	—	Baa2	—	BBB	—	—	—	2006年6月29日
2006年6月29日 (2006年6月23日)	第3回日本海信販株式会社 オートローン債権信託受益権	日本海信販株式会社	三菱UFJ証券 鳥取銀行	信託受益権	オートローン債権	優先受益権	10	1.33年	2011年4月27日	1ヶ月毎 バスル	—	—	—	AAA	—	—	—	—	2006年6月29日
2006年6月29日 (2006年6月27日)	株式会社キムラ手形債権 信託受益権・ABL06-06	株式会社キムラ	北海道銀行 住友信託銀行	信託受益権	商業手形	優先受益権	0.17	約0.2年	2006年10月17日	ハード・ブレット	—	J-1+	—	—	—	—	—	—	2006年7月13日
				ABL	商業手形	—	4.12	約0.2年	2006年10月17日	コントロール・ アフィリエイト	—	J-1+	—	—	—	—	—	—	2006年7月13日
2006年6月30日 (2006年6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 06-04-01	日発販売株式会社	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	3.3	2ヶ月	2006年9月4日	ハード・ブレット	—	—	—	a-1+	—	—	—	—	2006年6月30日
2006年6月30日 (2006年6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 06-05-01	日発販売株式会社	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	2006年10月4日	ハード・ブレット	—	—	—	a-1+	—	—	—	—	2006年6月30日
2006年6月30日 (2006年6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 06-06-01	日発販売株式会社	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11月2日	ハード・ブレット	—	—	—	a-1+	—	—	—	—	2006年6月30日
2006年6月30日 (2006年6月28日)	日立キャピタルオートリース マスタートラスト優先受益権 シリーズ2006-6	日立キャピタル オートリース株式会社	住友信託銀行	信託受益権	オートリース料債権	優先受益権	60	約1.97年	2011年6月30日	コントロール・ アフィリエイト	—	—	—	AAA	—	—	—	—	2006年7月13日
2006年7月3日 (2006年6月22日)	東海労働金庫第3回 住宅ローン債権信託受益権	東海労働金庫	BNPパリバ証券会社東京支店 三菱UFJ信託銀行	信託受益権	住宅ローン債権	優先受益権 クラス1	90	2.57年 (加重平均年限)	2041年7月5日	1ヶ月毎 バスル	—	—	—	AAA	AAA	1.37%	—	—	2006年7月6日
						優先受益権 クラス2	240	10.28年 (加重平均年限)	2041年7月5日	1ヶ月毎 バスル	—	—	—	AAA	AAA	2.44%	—	—	2006年7月6日
						メザニン受益権1	10	—	2041年7月5日	1ヶ月毎 バスル	—	—	—	AAA	AAA	(固定)	—	—	2006年7月6日
						メザニン受益権2	3	—	2041年7月5日	1ヶ月毎 バスル	—	—	—	AA	AA	(固定)	—	—	2006年7月6日
						メザニン受益権3	2	—	2041年7月5日	1ヶ月毎 バスル	—	—	—	AA	AA	(固定)	—	—	2006年7月6日
						セラー受益権1	8.5	—	2041年7月5日	—	—	—	—	AA	—	—	—	—	2006年7月6日
						劣後受益権11-17	17	—	2041年7月5日	—	—	—	—	AA	AA	—	—	—	2006年7月6日
						劣後受益権18-28	11	—	2041年7月5日	—	—	—	—	A	A	—	—	—	2006年7月6日
						劣後受益権29-38	10	—	2041年7月5日	—	—	—	—	BBB	BBB	—	—	—	2006年7月6日
						劣後受益権39-46	8	—	2041年7月5日	—	—	—	—	BBB	—	—	—	—	2006年7月6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				
2006年7月6日 (2006年6月26日)	貸付債権担保第44回 住宅金融公庫債券	住宅金融公庫	大和証券SMBC(事務幹事) みずほ証券 三菱UFJ証券	国内公募債	住宅ローン債権	—	512	—	2041年7月10日	1ヶ月毎 バスル	—	—	—	AAA	AAA	2.30%	0.42%	JGB第280回債	2006年7月6日
2006年7月7日 (2006年6月27日)	貸付債権担保S種第6回 住宅金融公庫債券	住宅金融公庫	大和証券SMBC(事務幹事) みずほ証券 三菱UFJ証券	国内公募債	住宅ローン債権	—	2,500	—	2037年5月10日	1ヶ月毎 バスル	—	—	—	AAA	AAA	2.26%	0.51%	JGB第256回債	2006年7月7日
2006年7月7日 (2006年6月30日)	国家公務員共済組合連合会 第3回CLOシニア特定目的会社	国家公務員 共済組合連合会	大和証券SMBC	国内私募債	信託受益権 (国家公務員共済 組合向け貸付債権)	A	200	3.9年	2021年6月10日	ソトブレット	—	—	—	AAA	AAA	1.48%	—	—	2006年7月7日
						B	100	5.9年	2021年6月10日	ソトブレット	—	—	—	AAA	AAA	1.89%	—	—	2006年7月7日
						C	100	7.9年	2021年6月10日	ソトブレット	—	—	—	AAA	AAA	2.17%	—	—	2006年7月7日
						D	100	10.9年	2021年6月10日	ソトブレット	—	—	—	AAA	AAA	2.40%	—	—	2006年7月7日
2006年7月7日 (2006年7月7日)	JML-マインズ信託受益権	—	メリルリンチ日本証券	信託受益権	商業用不動産担保 ローン債権	A1	335	—	2012年3月31日	—	AAA	—	Aaa	—	AAA	—	—	—	2006年7月7日
						A2	18	—	2012年3月31日	—	AAA	—	Aaa	—	AAA	—	—	—	2006年7月7日
						B1	76	—	2012年3月31日	—	AA	—	Aa2	—	AA	—	—	—	2006年7月7日
						B2	4	—	2012年3月31日	—	AA	—	Aa2	—	AA	—	—	—	2006年7月7日
						C1	66	—	2012年3月31日	—	A	—	A2	—	A	—	—	—	2006年7月7日
						C2	20	—	2012年3月31日	—	A	—	A2	—	A	—	—	—	2006年7月7日
						D1	67	—	2012年3月31日	—	BBB	—	Baa2	—	BBB	—	—	—	2006年7月7日
						D2	23	—	2012年3月31日	—	BBB	—	Baa2	—	BBB	—	—	—	2006年7月7日
						E1	52	—	2012年3月31日	—	BB	—	Ba2	—	BB	—	—	—	2006年7月7日
						E2	48	—	2012年3月31日	—	BB	—	Ba2	—	BB	—	—	—	2006年7月7日
						F	107	—	2012年3月31日	—	B	—	B2	—	B	—	—	—	2006年7月7日
						G	30	—	2012年3月31日	—	B-	—	B3	—	B-	—	—	—	2006年7月7日
2006年7月7日 (—)	JCOM 2006-2信託受益権	—	—	—	住宅ローン債権	X	846 (想定元本)	—	2012年3月31日	—	AAA	—	Aaa	—	AAA	—	—	—	2006年7月7日
						F号	150	—	2037年5月	—	—	—	—	—	AAA	—	—	—	2006年7月7日
						I号	150	—	2037年5月	—	—	—	—	—	AAA	—	—	—	2006年7月7日