

## 「証券化市場の動向調査」(2004年6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5月24日から6月11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	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4月30日 (2004年4月27日)	オレンジリー No.3	(株)オーエムシー カード	BNPパリバ証券会社 東京支店、 UFJ信託銀行	信託受益権	カードローン債権	優先受益権	200	4年	2012年4月30日	コントロールド・ アモortiセーション	-	-	Aaa	-	-	-	-	-	2004年4月30日
2004年5月14日 (2004年5月12日)	-	株式会社インター	HVBキャピタル 証券会社	信託受益権	事業者向けローン債権	インター優先 受益権2004 シリーズII	15	-	-	コントロールド・ アモortiセーション	-	-	-	-	-	-	-	-	2004年5月14日
2004年5月24日 (-)	ジェー・マイスター マスタートラスト Series 6	-	-	-	アパートローン債権	-	-	-	2036年10月31日	-	-	-	-	-	AAA	-	-	-	2004年6月11日
2004年5月25日 (2004年5月11日)	JLOC XVI Limited	モルガン・ スタンレー	モルガン・ スタンレー	ユーロ債	商業用不動産 担保ローン債権	A	80	6.1年	2013年5月15日	-	-	-	Aaa	-	AAA	-	0.32%	3ヶ月円LIBOR	2004年5月25日
						B	16	7.0年	2013年5月15日	-	-	-	Aa2	-	AA	-	0.55%	3ヶ月円LIBOR	2004年5月25日
						C	16	7.0年	2013年5月15日	-	-	-	A2	-	A	-	0.90%	3ヶ月円LIBOR	2004年5月25日
						D	8	7.0年	2013年5月15日	-	-	-	Baa1	-	BBB+	-	1.60%	3ヶ月円LIBOR	2004年5月25日
						X (IO債)	120 (想定元本)	-	-	-	-	-	Aaa	-	AAA	-	-	-	2004年5月25日
2004年5月27日 (2004年5月18日)	-	-	-	ユーロ債	CDS	-	-	5年	-	ハードプレット	-	-	-	-	-	-	-	-	2004年6月4日
2004年5月27日 (2004年5月21日)	第4回十八総合リース リース料債権 信託受益権	十八総合リース	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	21.2	4年10ヶ月	2010年5月27日	3ヶ月毎 コントロールド・ アモortiセーション	-	-	-	AAA	-	-	-	-	2004年5月27日
2004年5月31日 (2004年5月24日)	-	新生銀行	新生銀行	信託受益権	信託受益権 (企業向け貸付債権)	-	50	4.7年	2009年6月30日	1ヶ月 バースル	-	-	-	-	-	-	-	-	2004年6月7日
2004年5月31日 (2004年5月27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04-03-01 (追加信託分)	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	3.78	2ヶ月	2004年8月4日	ハードプレット	-	-	-	a-1+	-	-	-	-	2004年5月31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5月31日 (2004年5月27日)	手形債権流動化プログラム 日発売受益権 信託受益権04-04-01 (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	6.67	3ヶ月	2004年9月2日	ハード・ブレット	-	-	-	a-1+	-	-	-	-	2004年5月31日
2004年5月31日 (2004年5月27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	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	3.2	4ヶ月	2004年10月4日	ハード・ブレット	-	-	-	a-1+	-	-	-	-	2004年5月31日
2004年5月31日 ( - )	マッチ手形債権流動化プログラム 吉川紙商事手形債権 信託受益権04-01-01	吉川紙商事㈱	りそな銀行	信託受益権	商業手形	優先受益権	5.4	66日	2004年8月5日	ハード・ブレット	-	-	-	a-1	-	-	-	-	2004年5月31日
2004年5月31日 ( - )	マッチ手形債権流動化プログラム 吉川紙商事手形債権 信託受益権04-01-02	吉川紙商事㈱	りそな銀行	信託受益権	商業手形	優先受益権	4.3	91日	2004年8月30日	ハード・ブレット	-	-	-	a-1	-	-	-	-	2004年5月31日
2004年6月2日 (2004年5月25日)	R C C トラスト-V	整理回収機構、 キャピタル・サーゲイニング 債権回収株式会社、 サンライズファイナンス 株式会社、 大手都市銀行	リマン・ブラザーズ 証券会社、 三菱信託銀行、 整理回収機構	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	91	-	2009年5月27日	1ヶ月毎 パースル	-	-	Aaa	-	AAA	-	0.20%	1ヶ月円LIBOR (3%上限付)	2004年6月8日
						第二受益権	21	-	2009年5月27日	1ヶ月毎 パースル	-	-	Aa2	-	AA	-	0.40%	1ヶ月円LIBOR (3%上限付)	2004年6月8日
						第三受益権	18	-	2009年5月27日	1ヶ月毎 パースル	-	-	A2	-	A	-	0.70%	1ヶ月円LIBOR (3%上限付)	2004年6月8日
						第四受益権	18	-	2009年5月27日	1ヶ月毎 パースル	-	-	Baa2	-	BBB	-	1.25%	1ヶ月円LIBOR (3%上限付)	2004年6月8日
2004年6月7日 (2004年5月21日)	貸付債権担保第19回 住宅金融公庫債券	住宅金融公庫	日興証券グループ証券 (事務幹事)、 クレディスイスファースト オースト証券会社 東京支店、 みずほ証券	国内公募債	住宅ローン債権	-	300	-	2039年6月10日	1ヶ月毎 パースル	-	-	-	AAA	AAA	1.80%	0.32%	1.48% JGB259回償	2004年6月10日
2004年6月7日 ( - )	クロスオーバー・ ファンディング 株式会社	-	クレディスイスファースト オースト証券会社 東京支店	国内私募債	商業用不動産担保 ローン債権	A1	58	-	2011年3月	-	-	-	Aaa	-	-	-	-	-	2004年6月11日
						A2	251	-	2011年3月	-	-	-	Aaa	-	-	-	-	-	2004年6月11日
						B	44	-	2011年3月	-	-	-	Aa2	-	-	-	-	-	2004年6月11日
						C	30	-	2011年3月	-	-	-	A1	-	-	-	-	-	2004年6月11日
						D	35	-	2011年3月	-	-	-	A3	-	-	-	-	-	2004年6月11日
						E	24	-	2011年3月	-	-	-	Baa2	-	-	-	-	-	2004年6月11日

発行日 (条件決定日)	案件(発行者)名	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6月8日 (2004年6月2日)	アスカ(スカイラック)	-	ドレスナ - 銀行	ユーロ債	CDO ABS	A	50	5年	2009年12月	フレッツ	-	-	-	-	AAA	-	-	-	2004年6月8日
						B	30	5年	2009年12月	フレッツ	-	-	-	-	AAA	-	-	-	2004年6月8日
						C	15	5年	2009年12月	フレッツ	-	-	-	-	AA	-	-	-	2004年6月8日
						D	15	5年	2009年12月	フレッツ	-	-	-	-	A	-	-	-	2004年6月8日
2004年6月9日 (2004年6月3日)	ア・ファンディング・ワン	日本信販株式会社	メリリフ日本証券、 UFJつばさ証券	ユーロ債	信託受益権 (証書貸付債権、 カードローン債権)	A1	100	-	2014年4月18日	1ヶ月毎 コントロール・ アモリゲーション	AAA	-	Aaa	-	AAA	-	-	1ヶ月円LIBOR	2004年6月9日
						A2	208.3	-	2014年4月18日	1ヶ月毎 バースル	AAA	-	Aaa	-	AAA	-	-	1ヶ月円LIBOR	2004年6月9日
						B	15.6	-	2014年4月18日	1ヶ月毎 バースル	AA	-	Aa2	-	AA	-	-	1ヶ月円LIBOR	2004年6月9日
						C	20.5	-	2014年4月18日	1ヶ月毎 バースル	A	-	A2	-	A	-	-	1ヶ月円LIBOR	2004年6月9日
						D	37.9	-	2014年4月18日	1ヶ月毎 バースル	BBB	-	Baa2	-	BBB	-	-	1ヶ月円LIBOR	2004年6月9日

以 上