

「証券化市場の動向調査」（2005年11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、2005年10月17日から11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 ^d	基準金利	基準日
											Fitch	JCR	Moody's	R&I	S&P				
2005年10月20日 (2005年10月7日)	JLOC XXVIII シニア信託	-	モルガン・スタンレー証券会社 三菱UFJ信託銀行	信託受益権	商業用不動産	A	628	1.3	2012年10月9日	-	AAA	-	Aaa	-	AAA	-	0.18%	3ヶ月 円LIBOR	2005年11月7日
						B	101	2.1	2012年10月9日	-	AA	-	Aa2	-	AA	-	0.30%	3ヶ月 円LIBOR	2005年11月7日
						C	88	2.4	2012年10月9日	-	A	-	A2	-	A	-	0.50%	3ヶ月 円LIBOR	2005年11月7日
						D	72	2.6	2012年10月9日	-	BBB	-	Baa2	-	BBB	-	1.00%	3ヶ月 円LIBOR	2005年11月7日
2005年10月20日 (2005年10月7日)	JLOC XXVIII メザニン特定社債	-	モルガン・スタンレー証券会社	国内私募債	商業用不動産	TMK1	36	2.8	2012年10月9日	-	BB	-	Ba2	-	BB	-	3.15%	3ヶ月 円LIBOR	2005年11月7日
						TMK2	25	2.1	2012年10月9日	-	BB	-	Ba2	-	BB	-	3.15%	3ヶ月 円LIBOR	2005年11月7日
2005年10月20日 (2005年10月18日)	小口手形債権 一括流動化プログラム 優先受益権05-10-01-01	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	2.4	2ヶ月	2006年1月10日	ハードプレット	-	-	-	a-1	-	-	-	-	2005年10月31日
2005年10月20日 (2005年10月18日)	小口手形債権 一括流動化プログラム 優先受益権05-10-01-02	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2月3日	ハードプレット	-	-	-	a-1	-	-	-	-	2005年10月31日
2005年10月20日 (2005年10月18日)	小口手形債権 一括流動化プログラム 優先受益権05-10-01-03	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	0.7	4ヶ月	2006年3月3日	ハードプレット	-	-	-	a-1	-	-	-	-	2005年10月31日
2005年10月20日 (2005年10月18日)	東リ・リック手形債権 信託受益権05-10	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	8	106日	2006年2月3日	ハードプレット	-	-	-	a-1+	-	-	-	-	2005年11月11日
2005年10月25日 (2005年10月18日)	DTC Six Funding Limited	ニュー・センチュリー・ ファイナンス(株)	リーマン・ブラザーズ 証券会社	ユーロ債	アパートローン債権	A	246.1	-	2037年7月25日	-	AAA	-	Aaa	-	AAA	-	-	円LIBOR	2005年11月14日
						B	12	-	2037年7月25日	-	AA	-	Aa2	-	AA	-	-	円LIBOR	2005年11月14日
						C	12.6	-	2037年7月25日	-	A	-	A2	-	A	-	-	円LIBOR	2005年11月14日
						D	10	-	2037年7月25日	-	BBB	-	Baa2	-	BBB	-	-	円LIBOR	2005年11月14日
						E	11	-	2037年7月25日	-	BB	-	Ba2	-	BB	-	-	円LIBOR	2005年11月14日
						F	8.44	-	2037年7月25日	-	-	-	-	-	-	-	-	円LIBOR	2005年11月14日
						X (IO)	300.14 (想定元本)	-	2017年10月25日	-	AAA	-	Aaa	-	AAA	-	-	円LIBOR	2005年11月14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10月28日 (-)	第二回アサックス 不動産担保貸付債権信託	株式会社 アサックス	オリックス株式会社	信託受益権	不動産担保ローン債権	優先受益権	40	8年/5.5年	2015年3月23日	2008年10月 以降1ヶ月毎 バースル	-	-	-	A	-	-	-	3ヶ月 円LIBOR	2005年10月26日
2005年10月31日 (2005年10月24日)	HC-リストラストリース 16	日立キャピタル株式会社	日立キャピタル株式会社 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	77	-	2012年8月31日	コントラクト・ アモリシジョン	-	-	-	AAA	-	-	-	-	2005年10月31日
				信託受益権	信託受益権 (リース料債権)	優先受益権	26.3	-	2012年8月31日	1ヶ月毎 バースル	-	-	-	AAA	-	-	-	-	2005年10月31日
				A B L	信託受益権 (リース料債権)	特定借入	34	-	2012年8月31日	コントラクト・ アモリシジョン	-	-	-	AAA	-	-	-	-	2005年10月31日
2005年10月31日 (2005年10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 05-08-01	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	2.7	2ヶ月	2006年1月6日	ハードプレット	-	-	-	a-1+	-	-	-	-	2005年10月31日
2005年10月31日 (2005年10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 05-09-01	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	5.4	3ヶ月	2006年2月2日	ハードプレット	-	-	-	a-1+	-	-	-	-	2005年10月31日
2005年10月31日 (2005年10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 05-10-01	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	2.5	4ヶ月	2006年3月2日	ハードプレット	-	-	-	a-1+	-	-	-	-	2005年10月31日
2005年10月31日 (2005年10月27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 2005-10	日立キャピタル オートリース㈱	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	67.8	1.94年	2010年10月31日	ソフトプレット	-	-	-	AAA	-	-	-	-	2005年11月14日
2005年11月7日 (2005年10月21日)	貸付債権担保第36回 住宅金融公庫債券	住宅金融公庫	大和証券SMBC(事務主幹事) 野村證券 三菱UFJ証券	国内公募債	住宅ローン債権	-	772	-	2040年11月10日	1ヶ月毎 バースル	-	-	-	AAA	AAA	1.88%	0.38%	1.50% JGB273回償	2005年11月7日
2005年11月7日 (-)	NRF Trust 2005-6 信託受益権	-	-	-	住宅ローン債権	クラス 1	85	-	2040年11月	-	-	-	-	AAA	-	-	-	-	2005年11月7日
						クラス 2	85	-	2040年11月	-	-	-	-	AAA	-	-	-	-	2005年11月7日
2005年11月8日 (2005年10月28日)	J-CORE8	-	ドイツ証券会社 東京支店	信託受益権	商業用不動産等を 裏付けとした社債	Class A	227	5年	2012年12月31日	3ヶ月毎 バースル	-	-	Aaa	-	AAA	-	-	3ヶ月 円LIBOR	2005年11月8日
						Class B	35	5年	2012年12月31日	3ヶ月毎 バースル	-	-	Aa2	-	AA	-	-	3ヶ月 円LIBOR	2005年11月8日
						Class C	33	5年	2012年12月31日	3ヶ月毎 バースル	-	-	A2	-	A	-	-	3ヶ月 円LIBOR	2005年11月8日
						Class D	30	5年	2012年12月31日	3ヶ月毎 バースル	-	-	Baa2	-	BBB	-	-	3ヶ月 円LIBOR	2005年11月8日
						Class E	20	5年	2012年12月31日	3ヶ月毎 バースル	-	-	Ba2	-	BB	-	-	3ヶ月 円LIBOR	2005年11月8日
2005年11月9日 (2005年10月26日)	貸付債権担保S種第3回 住宅金融公庫債券	住宅金融公庫	大和証券SMBC(事務主幹事) 野村證券 三菱UFJ証券	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	1.82%	0.55%	1.27% JGB247回償	2005年11月9日
2005年11月9日 (2005年10月31日)	ORIX APL-J 信託	オリックス株式会社	オリックス株式会社	信託受益権	アパートローン債権	A号受益権	64	-	2037年10月5日	1ヶ月毎 バースル	-	-	Aaa	-	AAA	-	-	6ヶ月 円LIBOR	2005年10月31日
						B号受益権	3	-	2037年10月5日	1ヶ月毎 バースル	-	-	Aa2	-	AA	-	-	6ヶ月 円LIBOR	2005年10月31日
						C号受益権	3	-	2037年10月5日	1ヶ月毎 バースル	-	-	A2	-	A	-	-	6ヶ月 円LIBOR	2005年10月31日
						D号受益権	3	-	2037年10月5日	1ヶ月毎 バースル	-	-	Baa2	-	BBB	-	-	6ヶ月 円LIBOR	2005年10月31日
						X号受益権 (IO)	76.7 (想定元本)	-	2037年10月5日	1ヶ月毎 バースル	-	-	Aaa	-	AAA	-	-	6ヶ月 円LIBOR	2005年10月31日
2005年11月9日 (-)	JCOM 2005-3 信託受益権	-	-	-	住宅ローン債権	1号	225	-	2036年5月	-	-	-	-	AAA	-	-	-	-	2005年11月9日
						2号	100	-	2036年5月	-	-	-	-	AAA	-	-	-	-	2005年11月9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11月10日 (2005年10月14日)	アルベジオ・リミテッド シリーズ6	-	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225回債)	-	30	5年	2011年4月26日	プレツト	-	-	-	AA-	-	-	-	-	2005年11月10日
2005年11月10日 (-)	日立キャピタル 住宅ローン信託受益権	-	-	-	-	-	-	-	2036年2月	-	-	-	-	-	AAA	-	-	-	2005年11月10日
2005年11月11日 (2005年11月8日)	Rainbow Shark トラストファンディング	芙蓉総合リース 株式会社	三菱UFJ信託銀行	信託受益権	リース料債権	1号～5号 優先受益権	18.3	-	2011年5月31日	ソフトプレツト	-	-	-	AAA	-	-	-	-	2005年11月11日
						6号優先受益権	104.7	—	2011年5月31日	コントロールド・ アモルティゼーション	-	-	-	AAA	-	—	—	—	2005年11月11日
						7号優先受益権	28	—	2011年5月31日	1ヶ月毎 パースル	-	-	-	AAA	-	—	—	—	2005年11月11日

以 上