

「証券化市場の動向調査」(2006年6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、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、日本証券業協会及び全国銀行協会が、2006年5月17日から2006年6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5月18日 (2006年5月8日)	アルベジオ・リミテッド シリーズ7	—	Mizuho International plc	ユーロ債	日本企業120社を参照プールとする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)	クラスA-1	34	5.08年	2011年10月24日	フ レット	—	—	—	AA-	—	—	—	—	2006年5月18日
						クラスA-2	8	5.08年	2011年10月24日	フ レット	—	—	—	AA-	—	—	—	—	2006年5月18日
						クラスB	10	5.08年	2011年10月24日	フ レット	—	—	—	A-	—	—	—	—	2006年5月18日
2006年5月19日 (2006年5月12日)	第06-04(株)ジャックス ショッピングクレジット債権等 信託受益権	株式会社ジャックス	みずほ証券 みずほ信託銀行	信託受益権	クレジット債権	A号	128	1.08年	2011年4月14日	1ヶ月毎 コントロールド・ アモortiゼーション	—	—	—	AAA	—	—	—	—	2006年5月19日
						B号	100	1.34年	2011年4月14日	1ヶ月毎 バ スルー	—	—	—	AAA	—	—	—	—	2006年5月19日
2006年5月22日 (2006年5月15日)	L-MAP One 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	アパルトローン債権	A	175.4	—	2038年1月25日	—	AAA	—	Aaa	—	AAA	変動	—	6ヶ月LIBOR	2006年5月19日
						B	8	—	2038年1月25日	—	AA	—	Aa2	—	AA	変動	—	6ヶ月LIBOR	2006年5月19日
						C	5.8	—	2038年1月25日	—	A	—	A2	—	A	変動	—	6ヶ月LIBOR	2006年5月19日
						D	3.9	—	2038年1月25日	—	BBB	—	Baa2	—	BBB	変動	—	6ヶ月LIBOR	2006年5月19日
						E	1.92	—	2038年1月25日	—	—	—	—	—	—	—	—	—	2006年5月19日
						J-NIM	21.4	—	2038年1月25日	—	BBB	—	Baa2	—	BBB	固定	—	—	2006年5月19日
2006年5月22日 (2006年5月18日)	東リ・リック手形債権 信託受益権 06-05	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	10	106日	2006年9月5日	ハード・フ レット	-	-	-	a-1+	-	—	—	—	2006年6月5日
2006年5月24日 (2006年5月22日)	小口手形債権 一括流動化プログラム 優先受益権 06-05-01-01	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	2.7	2ヵ月	2006年8月3日	ハード・フ レット	-	-	-	a-1	-	-	-	-	2006年5月24日
2006年5月24日 (2006年5月22日)	小口手形債権 一括流動化プログラム 優先受益権 06-05-01-02	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	4.1	3ヵ月	2006年9月5日	ハード・フ レット	-	-	-	a-1	-	-	-	-	2006年5月24日
2006年5月24日 (2006年5月22日)	小口手形債権 一括流動化プログラム 優先受益権 06-05-01-03	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	1.4	4ヵ月	2006年10月5日	ハード・フ レット	-	-	-	a-1	-	-	-	-	2006年5月24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5月25日 (2006年5月23日)	MSN Trust Certificate Series 06050	メディア・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	40日程度	2006年7月4日	ハード・ブレット	-	J-1+	-	-	-	-	-	-	2006年6月1日
2006年5月25日 (2006年5月23日)	旭化成ヘーベルハウス マスタートラスト型RMBS シリーズ2006-3	旭化成モーゲージ株式会社	住友信託銀行	信託受益権	住宅ローン債権	シリーズ2006-3 A号優先受益権	12	2.8	2046年2月28日	1ヶ月毎 パススルー	-	-	-	-	AAA	-	-	-	2006年6月13日
						シリーズ2006-3 B号優先受益権	20	12.3	2046年2月28日	1ヶ月毎 パススルー	-	-	-	-	AAA	-	-	-	2006年6月13日
2006年5月31日 (2006年5月25日)	HC-リストラ シリーズ19	日立建機 外株式会社	日立建機 外株式会社 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	95.2	-	2013年3月29日	1ヶ月毎 コントロール・ アモチゼーション	-	-	-	AAA	-	-	-	-	2006年5月31日
				信託受益権	信託受益権 (リース料債権)	優先受益権	41.2	-	2013年3月29日	1ヶ月毎 パススルー	-	-	-	AAA	-	-	-	-	2006年5月31日
				A B L	信託受益権 (リース料債権)	特定借入	24.8	-	2013年3月29日	1ヶ月毎 コントロール・ アモチゼーション	-	-	-	AAA	-	-	-	-	2006年5月31日
2006年5月31日 (2006年5月29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 06-03-01	日発売株式会社	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	3.0	2ヶ月	2006年8月2日	ハード・ブレット	-	-	-	a-1+	-	-	-	-	2006年5月31日
2006年5月31日 (2006年5月29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 06-04-01	日発売株式会社	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	6.3	3ヶ月	2006年9月4日	ハード・ブレット	-	-	-	a-1+	-	-	-	-	2006年5月31日
2006年5月31日 (2006年5月29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 06-05-01	日発売株式会社	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	3.2	4ヶ月	2006年10月4日	ハード・ブレット	-	-	-	a-1+	-	-	-	-	2006年5月31日
2006年5月31日 (-)	MLD TRUST Series-30	三井リース事業株式会社	三菱UFJ信託銀行	信託受益権	リース料債権	優先受益権	250	-	2013年6月25日	コントロール・ アモチゼーション	-	-	-	AAA	-	-	-	-	2006年6月13日
2006年6月6日 (-)	三菱東京UFJ銀行 第2回住宅ローン債権 (全期間固定) 信託受益権	三菱東京UFJ銀行	三菱UFJ証券 ドイツ証券 三菱UFJ信託銀行(受託者)	信託受益権	住宅ローン債権	優先受益権 クラスA号	71	-	2043年4月27日	1ヶ月毎 パススルー	-	-	Aaa	-	-	固定	-	-	2006年6月6日
						優先受益権 クラスB号	550	-	2043年4月27日	1ヶ月毎 パススルー	-	-	Aaa	-	-	固定	-	-	2006年6月6日
						優先受益権 クラスC号	685	-	2043年4月27日	1ヶ月毎 パススルー	-	-	Aaa	-	-	固定	-	-	2006年6月6日
						メザニン受益権	105	-	2043年4月27日	1ヶ月毎 パススルー	-	-	A2	-	-	固定	-	-	2006年6月6日
2006年6月7日 (2006年5月26日)	貸付債権担保第43回 住宅金融公庫債券	住宅金融公庫	メリルリンチ日本証券 (事務幹事) 日興シティグループ証券 UBS証券会社東京支店	国内公募債	住宅ローン債権	-	889	-	2041年6月10日	1ヶ月毎 パススルー	-	-	-	AAA	AAA	2.28%	0.39%	JGB第279回債	2006年5月26日
2006年6月9日 (-)	Ulrey's Tetra トラスト ファunding	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	優先受益権	201	-	2012年4月27日	コントロール・ アモチゼーション 及びパススルー	-	AAA	-	-	-	-	-	-	2006年6月13日

以 上