

2 0 0 6 年 9 月 2 5 日
 (直 近 訂 正 日 : 2006 年 11 月 24 日)
 日 本 証 券 業 協 会

「証券化市場の動向調査」(2006年9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8月14日から2006年9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7月25日 (-)	ヤンマーククレジットサービス 第八回割賦債権信託受益権	ヤンマーククレジット サービス	りそな銀行	信託受益権	割賦債権	優先受益権	32.28	-	2011年10月20日	6ヶ月毎 コントロール・ アフェクション	-	-	-	AAA	-	-	-	-	2006年9月1日	
2006年8月10日 (2006年8月10日)	第7回SMBC-CLO	三井住友銀行	三井住友銀行	信託受益権	企業向け貸付債権	シニア	478	1.5年	2009年11月23日	3ヶ月毎 バスル	-	-	-	AAA	-	-	-	-	2006年9月13日	
						メザニン	32	1.5年	2009年11月23日	3ヶ月毎 バスル	-	-	-	A	-	-	-	-	2006年9月13日	
						劣後	25	1.5年	2009年11月23日	3ヶ月毎 バスル	-	-	-	B+	-	-	-	-	2006年9月13日	
2006年8月21日 (2006年8月10日)	-	-	みずほ証券	信託受益権	商業用不動産担保 ローン債権	A号	52	-	2013年8月19日	-	-	-	Aaa	-	-	-	-	-	2006年8月21日	
						B号	26	-	2013年8月19日	-	-	-	Aa2	-	-	-	-	-	-	2006年8月21日
						C号	14	-	2013年8月19日	-	-	-	A2	-	-	-	-	-	-	2006年8月21日
						D号	9.9	-	2013年8月19日	-	-	-	Baa2	-	-	-	-	-	-	2006年8月21日
						E号	0.1	-	2013年8月19日	-	-	-	Baa2	-	-	-	-	-	-	2006年8月21日
2006年8月21日 (2006年8月10日)	-	-	みずほ証券	A B L	商業用不動産	-	44	-	2013年8月15日	-	-	-	Baa2	-	-	-	-	-	2006年8月21日	
						国内私募債	1号	15	-	2013年8月15日	-	-	-	Ba2	-	-	-	-	-	2006年8月21日
				2号		15	-	2013年8月15日	-	-	-	B2	-	-	-	-	-	-	2006年8月21日	
2006年8月21日 (2006年8月11日)	Orso Funding CMBS 5 信託	ベアースタンズ(ジャパン) 証券会社 東京支店	ベアースタンズ(ジャパン) 証券会社 東京支店	信託受益権	商業用不動産	A	177	3.9年	2013年2月27日	-	AAA	-	Aaa	-	AAA	変動	-	3ヶ月円Libor	2006年8月21日	
						B	39	3.9年	2013年2月27日	-	AA	-	Aa2	-	AA	変動	-	3ヶ月円Libor	2006年8月21日	
						C	38	3.9年	2013年2月27日	-	A	-	A2	-	A	変動	-	3ヶ月円Libor	2006年8月21日	
						D	39	3.9年	2013年2月27日	-	BBB	-	Baa2	-	BBB	変動	-	3ヶ月円Libor	2006年8月21日	
						E	37	3.9年	2013年2月27日	-	BB	-	Ba2	-	BB	変動	-	3ヶ月円Libor	2006年8月21日	
						F	2.5	3.9年	2013年2月27日	-	BB-	-	Ba3	-	BB-	変動	-	3ヶ月円Libor	2006年8月21日	
2006年8月21日 (2006年8月17日)	東リ・リック手形債権 信託受益権06-08	東リ・リック	三菱UFJ信託銀行	信託受益権	商業手形	優先受益権	7	106日	2006年12月5日	ハードブレット	-	-	-	a-1+	-	-	-	2006年9月8日		
2006年8月21日 (2006年8月17日)	小口手形債権 一括流動化プロジェクト 優先受益権06-08-01-01	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	7.3	4ヶ月	2007年1月10日	ハードブレット	-	-	-	a-1	-	-	-	2006年8月21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8月23日 (2006年8月21日)	アンビシャス・ファンディング・ コーポレーション札幌支店	札幌通運	北洋銀行	サムライ私塾 A B C P	売掛債権	優先	3	2ヶ月	2006年10月31日	コントロール・ アフェクトーション	-	-	-	a-1	-	-	-	-	2006年8月23日
				A B L		優先	1	2ヶ月	2006年10月31日	ハードプレット	-	-	-	a-1	-	-	-	-	2006年8月23日
2006年8月25日 (2006年8月18日)	オリックス リーストラスト8号	オリックス	オリックス	信託受益権	リース料債権	A号	30	4.92年/2.2年	2014年2月28日	コントロール・ アフェクトーション	-	-	Aaa	-	-	固定	-	-	2006年8月18日
				A B L		A号ABL	80	4.92年/2.2年	2014年2月28日	1ヶ月毎 パスルー	-	-	Aaa	-	-	固定	-	-	2006年8月18日
				A B L		B号ABL	100	4.92年/2.2年	2014年2月28日	コントロール・ アフェクトーション	-	-	Aaa	-	-	固定	-	-	2006年8月18日
2006年8月25日 (2006年8月23日)	MSNW Trust Certificate Series 06080	メティカシステムワーク 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	9.5	40日程度	2006年10月3日	ハードプレット	-	J-1+	-	-	-	-	-	-	2006年9月11日
2006年8月25日 (2006年8月23日)	共友リース・リース料債権信託 優先受益権	共友リース	みずほ信託銀行	信託受益権	リース料債権	優先受益権	42.1	2.4年	2013年6月27日	3ヶ月毎 コントロール・ アフェクトーション	-	AAA	-	-	-	-	-	-	2006年8月25日
2006年8月28日 (2006年8月22日)	第2回香川銀リース リース料債権信託受益権	香川銀リース	三菱UFJ証券	信託受益権	リース料債権	優先受益権	20	1.94年	2012年8月27日	コントロール・ アフェクトーション	-	-	-	AAA	-	固定	-	-	2006年8月28日
2006年8月30日 (2006年8月23日)	第3回千葉県版CLO	千葉銀行	千葉銀行	信託受益権	企業向け貸付債権	クラスA	31	4年	2011年10月26日	6ヶ月毎 コントロール・ アフェクトーション	-	-	-	AAA	-	-	-	-	2006年9月13日
						クラスB	62	4年	2012年4月26日	1ヶ月毎 パスルー	-	-	-	AAA	-	-	-	-	2006年9月13日
						クラスC	22	4年	2012年4月26日	1ヶ月毎 パスルー	-	-	-	AA+	-	-	-	-	2006年9月13日
						クラスD	1	4年	2012年4月26日	1ヶ月毎 パスルー	-	-	-	BBB	-	-	-	-	2006年9月13日
2006年8月30日 (2006年8月23日)	オリックス オートトラスト 2006-1	オリックス自動車	オリックス	信託受益権	リース料債権	A号	409	4.33年/1.71年	2014年1月27日	コントロール・ アフェクトーション	-	-	Aaa	-	AAA	固定	-	-	2006年8月30日
						B号	100	2.83年/1.22年	2014年1月27日	1ヶ月毎 パスルー	-	-	Aaa	-	AAA	固定	-	-	2006年8月30日
2006年8月30日 (2006年8月24日)	第1回佐銀リース リース料債権信託受益権	佐銀リース	三菱UFJ証券	信託受益権	リース料債権	優先受益権	10	2.12年	2012年8月27日	コントロール・ アフェクトーション	-	-	-	AAA	-	固定	-	-	2006年8月30日
2006年8月30日 (2006年8月28日)	SFI第2回割賦債権流動化	ソニーファイナンス インターナショナル	大和証券SMB	信託受益権	クレジット債権	-	5	-	2011年11月30日	コントロール・ アフェクトーション	-	-	-	AAA	-	-	-	-	2006年8月28日
				A B L		-	81	-	2011年11月30日	コントロール・ アフェクトーション	-	-	-	AAA	-	-	-	-	2006年8月28日
2006年8月31日 (2006年8月24日)	UFJセントラルリース マスタートラスト シリーズ12	UFJセントラルリース	UFJセントラルリース 三菱UFJ信託銀行	信託受益権	リース料債権	第204優先受益権 (12-A1) ~ 第212優先受益権 (12-A9)	64	1~9ヶ月	2011年8月31日	ソフトプレット	-	-	-	-	AAA	変動	-	-	2006年8月31日
						第213優先受益権 (12-A10) ~ 第215優先受益権 (12-A12)	18	10~12ヶ月	2011年8月31日	ソフトプレット	-	-	-	-	AAA	固定	-	-	2006年8月31日
						第216優先受益権 (12-B1)	116	2年1ヶ月	2011年8月31日	コントロール・ アフェクトーション	-	-	-	-	AAA	固定	-	-	2006年8月31日
						第217優先受益権 (12-B2)	42	3年5ヶ月	2011年8月31日	コントロール・ アフェクトーション	-	-	-	-	AAA	固定	-	-	2006年8月31日
						第218優先受益権 (12-A13) ~ 第234優先受益権 (12-A29)	80	3年8ヶ月~5年	2011年8月31日	ソフトプレット	-	-	-	-	AAA	固定	-	-	2006年8月31日
						第235優先受益権 (12-C1)	70	2ヶ月(予定)	2011年8月31日	1ヶ月毎 パスルー	-	-	-	-	AAA	変動	-	-	2006年8月31日
2006年8月31日 (2006年8月29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	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	2ヶ月	2006年11月2日	ハードプレット	-	-	-	a-1+	-	-	-	-	2006年8月31日
2006年8月31日 (2006年8月29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 06-07-01	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	5.6	3ヶ月	2006年12月4日	ハードプレット	-	-	-	a-1+	-	-	-	-	2006年8月31日
2006年8月31日 (2006年8月29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 06-08-01	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	3.0	4ヶ月	2007年1月9日	ハードプレット	-	-	-	a-1+	-	-	-	-	2006年8月31日
2006年8月31日 (2006年8月29日)	アンビシャス・ファンディング・ コーポレーション札幌支店	ナラサキ産業	北洋銀行	サムライ私塾 A B C P	手形債権	優先	9	2ヶ月	2006年11月6日	コントロール・ アフェクトーション	-	-	-	a-1	-	-	-	-	2006年8月31日
				A B L		優先	1	2ヶ月	2006年11月6日	ハードプレット	-	-	-	a-1	-	-	-	-	2006年8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				
2006年8月31日 (-)	三菱東京UFJ銀行第3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	信託受益権	住宅ローン債権	優先受益権 クラスA号	320	-	2043年6月25日	1ヶ月毎 バスル	-	-	Aaa	-	-	固定	-	-	2006年8月31日
						優先受益権 クラスB号	410	-	2043年6月25日	1ヶ月毎 バスル	-	-	Aaa	-	-	固定	-	-	2006年8月31日
						優先受益権 クラスC号	203	-	2043年6月25日	1ヶ月毎 バスル	-	-	Aaa	-	-	固定	-	-	2006年8月31日
						優先受益権 クラスD号	896	-	2043年6月25日	1ヶ月毎 バスル	-	-	Aaa	-	-	固定	-	-	2006年8月31日
						メザニン受益権	147	-	2043年6月25日	1ヶ月毎 バスル	-	-	A2	-	-	固定	-	-	2006年8月31日
2006年8月31日 (-)	東京リース株式会社 リース料債権信託優先受益権07	東京リース	三菱UFJ信託銀行	信託受益権	リース料債権	優先受益権	300	-	2011年10月5日	3ヶ月毎 コントロール・ アフェクション	-	-	-	AAA	-	-	-	-	2006年9月8日
2006年9月5日 (2006年8月24日)	貸付債権担保第46回 住宅金融公庫債券	住宅金融公庫	ドイツ証券(事務幹事) 三菱UFJ証券 モルガン・スタンレー証券	国内公募債	住宅ローン債権	-	635	-	2041年9月10日	1ヶ月毎 バスル	-	-	-	AAA	AAA	2.27%	0.46%	JGB第280回債	2006年9月5日
2006年9月7日 (2006年8月31日)	MSP 受益権	-	みずほ証券	信託受益権	不動産担保付 貸付債権	A1号受益権	184	-	2013年4月26日	3ヶ月毎 バスル	-	-	A2	-	-	-	-	-	2006年9月7日
				A B L		A号ABL	10	-	2013年4月26日	3ヶ月毎 バスル	-	-	A2	-	-	-	-	-	2006年9月7日
				信託受益権		B1号受益権	175	-	2013年4月26日	3ヶ月毎 バスル	-	-	Baa3	-	-	-	-	-	2006年9月7日
				A B L		B号ABL	20	-	2013年4月26日	3ヶ月毎 バスル	-	-	Baa3	-	-	-	-	-	2006年9月7日
				信託受益権		C1号受益権	72.3	-	2013年4月26日	3ヶ月毎 バスル	-	-	Ba1	-	-	-	-	-	2006年9月7日
				信託受益権		D号受益権	0.1	-	2013年4月26日	3ヶ月毎 バスル	-	-	A2	-	-	-	-	-	2006年9月7日
				信託受益権		E号受益権	0.3	-	2013年4月26日	3ヶ月毎 バスル	-	-	A2	-	-	-	-	-	2006年9月7日
2006年9月8日 (2006年9月5日)	Variatusトラストファンディング	芙蓉総合リース	みずほ信託銀行	信託受益権	リース料債権	優先受益権	163	-	2011年9月30日	コントロール・ アフェクション	-	AAA	-	-	-	-	-	-	2006年9月8日
						優先受益権	40	-	2011年9月30日	1ヶ月毎 バスル	-	AAA	-	-	-	-	-	-	2006年9月8日