

「証券化市場の動向調査」（2004年10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、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、日本銀行が、2004年9月14日から10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 ¹⁾	基準金利	基準日
											Fitch	JCR	Moody's	R&I	S&P				
2004年9月16日 (2004年9月9日)	横浜銀行第2回住宅ローン 債権信託受益権	横浜銀行	日興証券グループ証券（幹事会社） 野村證券（引受会社） 大和証券SMBC（引受会社） 三菱信託銀行（受託者）	信託受益権	住宅ローン債権	第1優先受益権	310	-	2038年12月10日	1ヶ月毎月 元金均等返済	-	-	-	-	AAA	1.71%	-	-	2004年10月14日
						第2優先受益権	133	-	2038年12月10日	1ヶ月毎月 元金均等返済	-	-	-	-	AAA	-	0.24%	1ヶ月円 LIBOR	2004年10月14日
2004年9月16日 (2004年9月10日)	三和キャピタルネクサス 特定目的会社	三和ファイナンス 株式会社	HVBキャピタル証券会社 東京支店	国内私募債	消費者ローン債権	A号特定社債	104	4年8ヶ月	2013年3月25日	元金均等返済・ 元金元金均等返済	-	-	Aa2	-	AA	-	-	1ヶ月円 LIBOR	2004年9月16日
						B号特定社債	16	5年11ヶ月	2013年3月25日	元金均等返済・ 元金元金均等返済	-	-	-	-	A	-	-	1ヶ月円 LIBOR	2004年9月16日
2004年9月16日 (2004年9月14日)	(有)ヘルシア・ファンディング・ コーポレーション（徳洲会）	医療法人徳洲会 及びヘルシア・法人	野村信託銀行	信託受益権	診療報酬等債権	優先受益権	19	1.5ヶ月	2004年11月1日	ハード・プレット	-	J-1+	-	-	-	-	-	-	2004年9月16日
2004年9月17日 (2004年9月6日)	コスミック・ファンディング 特定目的会社	新生銀行	新生銀行	国内私募債	商業用不動産担保 ローン債権	A	570	4.5年	2011年3月15日	ハード・プレット	-	-	Aaa	-	AAA	-	0.25%	3ヶ月円 LIBOR	2004年9月30日
						B	120	4.5年	2011年3月15日	ハード・プレット	-	-	Aa2	-	AA	-	0.45%	3ヶ月円 LIBOR	2004年9月30日
						C	126	4.5年	2011年3月15日	ハード・プレット	-	-	A2	-	A	-	0.70%	3ヶ月円 LIBOR	2004年9月30日
						D	54	4.5年	2011年3月15日	ハード・プレット	-	-	A3	-	A-	-	0.80%	3ヶ月円 LIBOR	2004年9月30日
2004年9月17日 (2004年9月15日)	ヤンマークレジットサービス 第四回割賦債権信託受益権	ヤンマークレジット サービス株式会社	みずほコーポレート銀行	信託受益権	クレジット債権	-	30.8	-	-	元金均等返済・ 元金元金均等返済	-	-	-	AAA	-	-	-	-	2004年9月17日
2004年9月17日 (-)	-	-	住友信託銀行	信託受益権	リース料債権	-	210	2年	2010年5月	元金均等返済・ 元金元金均等返済	-	-	Aaa	-	-	-	-	-	2004年10月14日
2004年9月21日 (2004年9月14日)	いすゞ自動車中国㈱ 手形債権証券化	いすゞ自動車中国㈱	広島銀行	信託受益権	手形債権 (割賦手形を含む)	優先受益権	20	-	2009年9月27日	-	-	-	-	-	AA	-	-	-	2004年10月14日
						セラー受益権	17	-	2009年9月27日	-	-	-	-	-	-	-	-	-	2004年10月14日
						劣後受益権	8	-	2009年9月27日	-	-	-	-	-	-	-	-	-	2004年10月14日
2004年9月21日 (2004年9月16日)	小口手形債権一括流動化 ﾌﾞﾛｸﾞ Ⅲ優先受益権 04-09-01-01	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	1.1	2ヶ月	2004年12月3日	ハード・プレット	-	-	-	a-1+	-	-	-	-	2004年9月30日
2004年9月21日 (2004年9月16日)	小口手形債権一括流動化 ﾌﾞﾛｸﾞ Ⅲ優先受益権 04-09-01-02	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	1.0	3ヶ月	2005年1月7日	ハード・プレット	-	-	-	a-1+	-	-	-	-	2004年9月30日
2004年9月21日 (2004年9月16日)	小口手形債権一括流動化 ﾌﾞﾛｸﾞ Ⅲ優先受益権 04-09-01-03	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	1.0	4ヶ月	2005年2月3日	ハード・プレット	-	-	-	a-1+	-	-	-	-	2004年9月30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9月21日 (2004年9月16日)	東リ・リック手形債権 信託受益権04-09	東リ(株)・ リック(株)	UFJ信託銀行	信託受益権	商業手形	優先受益権	8	108日	2005年1月7日	ハードプレット	-	-	-	a-1+	-	-	-	-	2004年10月13日
2004年9月22日 (2004年9月14日)	OSCAR Funding Corp.XIII	オリエント コーポレーション	Mizuho International plc	ユー口債	オートローン債権	-	1億2,500万ドル・ 1億5,250万ユーロ (総額円換算342億円)	-	2011年9月12日	1ヶ月毎 バスル	-	-	Aaa	-	AAA	-	-	-	2004年9月30日
2004年9月22日 (2004年9月22日)	第3回びぎん総合リース リース料債権信託受益権	びぎん総合リース	三菱証券 三菱信託銀行	信託受益権	リース料債権	優先受益権	24.2	1.93年	2010年10月20日	3ヶ月毎 コントロール・ アフェレーション	-	-	-	AAA	-	-	-	-	2004年9月22日
2004年9月22日 (-)	コスモス・モーゲージ トラスト優先受益権	千葉興業銀行	みずほ証券 みずほ信託銀行	信託受益権	住宅ローン債権	優先受益権	518	5.38年	2038年4月25日	1ヶ月毎 バスル	-	-	Aaa	-	-	-	-	-	2004年9月30日
2004年9月22日 (-)	こまちトラスト優先受益権	北都銀行	みずほ証券 みずほ信託銀行	信託受益権	住宅ローン債権	優先受益権	246	-	2040年12月25日	1ヶ月毎 バスル	-	-	Aaa	-	-	-	-	-	2004年9月22日
2004年9月24日 (2004年9月21日)	ルミエール(2004-9)	株式会社オリエント コーポレーション	BNPパリバ証券会社東京支店 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	124	1年1ヶ月 (加重平均年限)	2009年9月30日	1ヶ月毎 バスル	-	-	Aaa	-	AAA	-	-	-	2004年9月30日
2004年9月24日 (-)	ORIX-NRL信託 信託受益権	オリックス株式会社	オリックス株式会社	信託受益権	商業用不動産担保 ローン債権	A号受益権	106	3.62年	2011年3月8日	3ヶ月毎 バスル	-	-	Aaa	-	AAA	-	-	-	2004年9月24日
						B号受益権	17	4.46年	2011年3月8日	3ヶ月毎 バスル	-	-	Aa2	-	AA	-	-	-	2004年9月24日
						C号受益権	16	4.46年	2011年3月8日	3ヶ月毎 バスル	-	-	A2	-	A	-	-	-	2004年9月24日
						D号受益権	13	4.46年	2011年3月8日	3ヶ月毎 バスル	-	-	Baa2	-	BBB	-	-	-	2004年9月24日
						X号受益権 (O)	152 (想定元本)	4.46年	2011年3月8日	3ヶ月毎 バスル	-	-	Aaa	-	AAA	-	-	-	2004年9月24日
2004年9月28日 (2004年9月10日)	クレア・ファイブ 特定目的会社	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	379	2.12年	2010年9月14日	1年後から 1ヶ月毎 コントロール・ アフェレーション	-	-	Aaa	-	AAA	-	-	-	2004年10月1日
						B	71	2.12年	2010年9月14日	1年後から 1ヶ月毎 コントロール・ アフェレーション	-	-	Baa2	-	BBB	-	-	-	2004年10月1日
2004年9月28日 (2004年9月13日)	-	-	日興シティグループ証券	国内私募債	消費者ローン債権	-	200	約3年	2014年10月10日	コントロール・ アフェレーション	AAA	-	Aaa	-	-	-	-	-	2004年10月14日
2004年9月28日 (2004年9月17日)	中央三井信託銀行株式会社 第3回住宅ローン債権 信託受益権	中央三井信託銀行 株式会社	大和証券SMBC 三井アセット信託銀行 (受託者)	信託受益権	住宅ローン債権	クラスA1 優先受益権	380	-	2039年5月10日	1ヶ月毎 バスル	-	-	Aaa	-	-	-	-	-	2004年9月30日
						クラスA2 優先受益権	250	-	2039年5月10日	1ヶ月毎 バスル	-	-	Aaa	-	-	-	-	-	2004年9月30日
2004年9月28日 (-)	イコ/オートリース料債権 信託優先受益権	株式会社イフコ	オリックス株式会社	信託受益権	リース料債権	優先受益権	100	1.79年	2011年9月30日	コントロール・ アフェレーション	-	-	-	-	AAA	-	-	-	2004年9月28日
2004年9月28日 (-)	-	-	住友信託銀行	信託受益権	リース料債権	-	103	2年	2011年10月	コントロール・ アフェレーション	-	-	-	-	AAA	-	-	-	2004年10月14日
2004年9月29日 (2004年9月24日)	第4回株式会社西日本総合 リース信託受益権	株式会社西日本 総合リース	中央三井信託銀行 三井アセット信託銀行(受託者)	信託受益権	リース料債権	優先受益権	33.4	1年10ヶ月	2013年2月28日	1ヶ月毎 コントロール・ アフェレーション	-	-	-	-	AAA	-	-	-	2004年10月14日
2004年9月29日 (2004年9月27日)	ジャニス工業手形債権 信託受益権04-09	ジャニス工業(株)	UFJ信託銀行	信託受益権	商業手形	優先受益権	1	108日	2005年1月14日	ハードプレット	-	-	-	a-1+	-	-	-	-	2004年10月13日
2004年9月29日 (-)	-	-	UFJつばさ証券	サムライ私募債	信託受益権 (企業向け貸付債権)	A号社債	14	3年	2009年9月	3ヶ月毎 バスル	-	-	A2	-	A	-	-	-	2004年9月29日
						B号社債	7.5	3年	2009年9月	3ヶ月毎 バスル	-	-	Baa3	-	BBB-	-	-	-	2004年9月29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9月30日 (2004年9月21日)	シナジーファンディング 優先受益権	新生銀行	新生銀行	信託受益権	証券化商品 (CMBS等)	A	255	2.27年	2013年10月15日	3ヶ月毎 バースル	AAA	-	-	-	AAA	-	0.30%	3ヶ月円 LIBOR	2004年9月30日
						B	22	3.79年	2013年10月15日	3ヶ月毎 バースル	AA	-	-	-	AA	-	0.40%	3ヶ月円 LIBOR	2004年9月30日
						C	25	4.18年	2013年10月15日	3ヶ月毎 バースル	A	-	-	-	A	-	0.70%	3ヶ月円 LIBOR	2004年9月30日
						D	24	4.73年	2013年10月15日	3ヶ月毎 バースル	BBB	-	-	-	BBB	-	1.50%	3ヶ月円 LIBOR	2004年9月30日
						E	25	4.79年	2013年10月15日	3ヶ月毎 バースル	BB	-	-	-	BB	-	3.50%	3ヶ月円 LIBOR	2004年9月30日
2004年9月30日 (2004年9月24日)	DPI&RCC ファンディング	大和証券SMBC ブリッジ・ビル・ インベストメント株式会社	大和証券SMBC(アレンジャー) 整理回収機構及び 住友信託銀行(受託者)	信託受益権	不良債権等	第一優先受益権	39	-	2009年9月30日	1ヶ月毎 バースル	-	-	Aaa	-	AAA	-	-	1ヶ月円 LIBOR	2004年9月30日
						第二優先受益権	15	-	2009年9月30日	1ヶ月毎 バースル	-	-	Aa2	-	AA	-	-	1ヶ月円 LIBOR	2004年9月30日
						第三優先受益権	15	-	2009年9月30日	1ヶ月毎 バースル	-	-	A2	-	A	-	-	1ヶ月円 LIBOR	2004年9月30日
						第四優先受益権	15	-	2009年9月30日	1ヶ月毎 バースル	-	-	Baa2	-	BBB	-	-	1ヶ月円 LIBOR	2004年9月30日
2004年9月30日 (2004年9月24日)	U F J セントラルリース マスタートラスト シリーズ6	U F J セントラルリース	U F J セントラルリース U F J 信託銀行	信託受益権	リース料債権	第62優先受益権 (6-A1)	9	1ヶ月	2009年9月30日	ソトブレット	-	-	-	-	AAA	-	-	-	2004年9月30日
						第63優先受益権 (6-A2)	9	2ヶ月	2009年9月30日	ソトブレット	-	-	-	-	AAA	-	-	-	2004年9月30日
						第64優先受益権 (6-A3)	9	3ヶ月	2009年9月30日	ソトブレット	-	-	-	-	AAA	-	-	-	2004年9月30日
						第65優先受益権 (6-A4)	8	4ヶ月	2009年9月30日	ソトブレット	-	-	-	-	AAA	-	-	-	2004年9月30日
						第66優先受益権 (6-A5)	8	5ヶ月	2009年9月30日	ソトブレット	-	-	-	-	AAA	-	-	-	2004年9月30日
						第67優先受益権 (6-A6)	7	6ヶ月	2009年9月30日	ソトブレット	-	-	-	-	AAA	-	-	-	2004年9月30日
						第68優先受益権 (6-A7)	6	7ヶ月	2009年9月30日	ソトブレット	-	-	-	-	AAA	-	-	-	2004年9月30日
						第69優先受益権 (6-A8)	6	8ヶ月	2009年9月30日	ソトブレット	-	-	-	-	AAA	-	-	-	2004年9月30日
						第70優先受益権 (6-A9)	6	9ヶ月	2009年9月30日	ソトブレット	-	-	-	-	AAA	-	-	-	2004年9月30日
						第71優先受益権 (6-A10)	6	10ヶ月	2009年9月30日	ソトブレット	-	-	-	-	AAA	-	-	-	2004年9月30日
						第72優先受益権 (6-A11)	6	11ヶ月	2009年9月30日	ソトブレット	-	-	-	-	AAA	-	-	-	2004年9月30日
						第73優先受益権 (6-A12)	6	12ヶ月	2009年9月30日	ソトブレット	-	-	-	-	AAA	-	-	-	2004年9月30日
						第74優先受益権 (6-B1)	132	1年11ヶ月	2009年9月30日	エントロピー・ アフィリエイト	-	-	-	-	AAA	-	-	-	2004年9月30日
						第75優先受益権 (6-B2)	100	3年7ヶ月	2009年9月30日	エントロピー・ アフィリエイト	-	-	-	-	AAA	-	-	-	2004年9月30日
						第76優先受益権 (6-C1)	50	4ヶ月	2009年9月30日	1ヶ月毎 バースル	-	-	-	-	AAA	-	-	-	2004年9月30日
2004年9月30日 (2004年9月27日)	第一回リース料債権信託 優先受益権	千葉総合リース 株式会社	みずほ信託銀行	信託受益権	リース料債権	優先受益権	20	2年	2009年9月10日	エントロピー・ アフィリエイト	-	-	-	AAA	-	-	-	-	2004年9月30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9月30日 (2004年9月28日)	第一回 加藤製作所 割賦債権信託優先受益権	㈱加藤製作所	㈱りそな銀行	信託受益権	割賦債権	第一優先受益権	15.3	1年	2009年11月6日	3ヶ月毎 払戻	-	-	-	AAA	-	-	-	-	2004年9月30日
						第二優先受益権	3.8	2年7ヶ月	2009年11月6日	3ヶ月毎 払戻	-	-	-	BBB	-	-	-	-	2004年9月30日
2004年9月30日 (2004年9月28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 04-07-01(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	3.27	2ヶ月	2004年12月2日	ハード・ブレット	-	-	-	A-1+	-	-	-	-	2004年9月30日
2004年9月30日 (2004年9月28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 04-08-01(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	5.7	3ヶ月	2005年1月6日	ハード・ブレット	-	-	-	A-1+	-	-	-	-	2004年9月30日
2004年9月30日 (2004年9月28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 04-09-01	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	2.81	4ヶ月	2005年2月2日	ハード・ブレット	-	-	-	A-1+	-	-	-	-	2004年9月30日
2004年9月30日 (-)	広域CLO (東京都・神奈川県・ 横浜市・川崎市合同)	(セー) 中小企業金融公庫 (リジネーター) UFJ銀行 東京都民銀行 八千代銀行	UFJ銀行 UFJつばさ証券	信託受益権	中小企業向け 貸付債権	優先受益権	10.85	3年	2008年10月15日	3ヶ月毎 コントロール・ アフェクトーション	-	-	Aaa	-	-	0.49%	-	-	2004年9月30日
						メソニ受益権	1.82	3年	2008年10月15日	3ヶ月毎 コントロール・ アフェクトーション	-	-	A2	-	-	0.89%	-	-	2004年9月30日
						ジュニアメソニ 受益権	1.4	3年	2008年10月15日	3ヶ月毎 コントロール・ アフェクトーション	-	-	Baa2	-	-	-	-	-	2004年9月30日
2004年9月30日 (-)	-	-	住友信託銀行	信託受益権	リース料債権	-	174	1.5年	2009年9月	コントロール・ アフェクトーション	-	-	-	AAA	-	-	-	-	2004年10月14日
2004年10月5日 (2004年9月22日)	JPM - JC7	JPモルガン・ チェース銀行 J.P.モルガン証券会社	J.P.モルガン証券会社 モルガン信託銀行	信託受益権	商業用不動産担保 ローン債権	A	168	4.6年	2011年7月26日	アンコントロール・ アフェクトーション	AAA	-	Aaa	-	-	-	-	-	2004年10月5日
						B	31	4.7年	2011年7月26日	アンコントロール・ アフェクトーション	AA	-	Aa2	-	-	-	-	-	2004年10月5日
						C	30	4.8年	2011年7月26日	アンコントロール・ アフェクトーション	A	-	A2	-	-	-	-	-	2004年10月5日
						D	30	4.8年	2011年7月26日	アンコントロール・ アフェクトーション	BBB	-	Baa2	-	-	-	-	-	2004年10月5日
						E	21	4.8年	2011年7月26日	アンコントロール・ アフェクトーション	BB+	-	Ba1	-	-	-	-	-	2004年10月5日
						X	280 (想定元本)	4.8年	2011年7月26日	アンコントロール・ アフェクトーション	AAA	-	Aaa	-	-	-	-	-	2004年10月5日
2004年10月6日 (2004年9月21日)	貸付債権担保第23回 住宅金融公庫債券	住宅金融公庫	ゴールドマン・サックス証券会社 東京支店(事務主幹事) 日興フィナンシャル証券株式会社 UFJつばさ証券株式会社	国内公募債	住宅ローン債権	-	300	-	2039年10月10日	1ヶ月毎 払戻	-	-	-	AAA	AAA	1.79%	0.28%	1.51% JGB263回償	2004年10月14日

以上