

「証券化市場の動向調査」(2006年5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、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、日本証券業協会及び全国銀行協会が、2006年4月14日から2006年5月16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	ｽﾌﾟﾚｯﾄ*	基準金利	基準日
											Fitch	JCR	Moody's	R&I	S&P				
2006年4月20日 (2006年4月18日)	小口手形債権一括流動化 ﾌﾟﾛｸﾞﾗﾑ優先受益権 06-04-01-01	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	2.8	2ヶ月	2006年7月5日	ﾊｰﾄﾞﾌﾞﾚｯﾄ	—	—	—	a-1	—	—	—	—	2006年4月20日
2006年4月20日 (2006年4月18日)	小口手形債権一括流動化 ﾌﾟﾛｸﾞﾗﾑ優先受益権 06-04-01-02	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	5.6	3ヶ月	2006年8月3日	ﾊｰﾄﾞﾌﾞﾚｯﾄ	—	—	—	a-1	—	—	—	—	2006年4月20日
2006年4月20日 (2006年4月18日)	小口手形債権一括流動化 ﾌﾟﾛｸﾞﾗﾑ優先受益権 06-04-01-03	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	1.3	4ヶ月	2006年9月5日	ﾊｰﾄﾞﾌﾞﾚｯﾄ	—	—	—	a-1	—	—	—	—	2006年4月20日
2006年4月20日 (2006年4月18日)	東リ・リック手形債権 信託受益権06-04	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	9	105日	2006年8月3日	ﾊｰﾄﾞﾌﾞﾚｯﾄ	—	—	—	a-1+	—	—	—	—	2006年5月15日
2006年4月24日 (2006年4月20日)	株式会社ｷﾑﾗ手形債権 信託受益権・ABL06-04	株式会社ｷﾑﾗ	北海道銀行 住友信託銀行	信託受益権	商業手形	優先受益権	3.51	0.25年	2006年8月17日	ﾊｰﾄﾞﾌﾞﾚｯﾄ	—	J-1+	—	—	—	—	—	—	2006年5月16日
				A B L	商業手形	—	0.09	0.25年	2006年8月17日	ｺﾝﾄﾛｰﾙﾄﾞ・ ﾌﾚｯｼｭﾍﾞｰｼｮﾝ	—	J-1+	—	—	—	—	—	—	2006年5月16日
2006年4月25日 (2006年4月21日)	MSNW Trust Certificate Series 06040	ﾏｲｶﾐｽﾃﾑﾈｯﾄﾜｰｸの 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	10	40日程度	2006年6月2日	ﾊｰﾄﾞﾌﾞﾚｯﾄ	—	J-1+	—	—	—	—	—	—	2006年5月15日
2006年4月28日 (2006年4月19日)	福岡銀行第1回住宅ﾛｰﾝ債権 ｽﾀﾝﾀﾞｰﾄﾞﾘｻﾞｰ参照型受益権	福岡銀行	野村證券	信託受益権	住宅ローン債権	—	168	—	2041年3月27日	1ヶ月毎 ﾊﾞｽｽﾙｰ	—	—	Aaa	AAA	—	—	—	—	2006年4月19日
2006年4月28日 (2006年4月26日)	手形債権流動化ﾌﾟﾛｸﾞﾗﾑ 日発販売受益権信託受益権 06-02-01	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	2.8	2ヶ月	2006年7月4日	ﾊｰﾄﾞﾌﾞﾚｯﾄ	—	—	—	a-1+	—	—	—	—	2006年4月28日
2006年4月28日 (2006年4月26日)	手形債権流動化ﾌﾟﾛｸﾞﾗﾑ 日発販売受益権信託受益権 06-03-01	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	6.3	3ヶ月	2006年8月2日	ﾊｰﾄﾞﾌﾞﾚｯﾄ	—	—	—	a-1+	—	—	—	—	2006年4月28日
2006年4月28日 (2006年4月26日)	手形債権流動化ﾌﾟﾛｸﾞﾗﾑ 日発販売受益権信託受益権 06-04-01	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	4ヶ月	2006年9月4日	ﾊｰﾄﾞﾌﾞﾚｯﾄ	—	—	—	a-1+	—	—	—	—	2006年4月28日
2006年4月28日 (—)	セトラﾌｳｲﾔﾝｽ 第2回ｶｰﾄﾞｷｬｯｼﾝｸﾞ債権 信託受益権	セトラﾌｳｲﾔﾝｽ	三菱UFJ証券	信託受益権	ｶｰﾄﾞｷｬｯｼﾝｸﾞ債権	優先受益権	90	—	2013年4月30日	1ヶ月毎 ﾊﾞｽｽﾙｰ	—	—	Aaa	—	AAA	—	—	—	2006年4月28日
						ﾒﾞｻﾞﾆﾝ受益権	10	—	2013年4月30日	1ヶ月毎 ﾊﾞｽｽﾙｰ	—	—	A2	—	A	—	—	—	

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2日 (2006年4月25日)	N-SLOT Opus 4信託受益権	野村證券	野村證券	信託受益権	特定社債	A号受益権	74	2011年3月15日	2013年3月15日	コントロールド・ アモチゼーション	—	—	—	AAA	—	—	—	—	2006年4月25日
						B号受益権	17	2011年3月15日	2013年3月15日	ソフトプレット	—	—	—	AA	—	—	—	—	2006年4月25日
						C号受益権	16	2011年3月15日	2013年3月15日	ソフトプレット	—	—	—	A	—	—	—	—	2006年4月25日
						D号受益権	14	2011年3月15日	2013年3月15日	ソフトプレット	—	—	—	BBB	—	—	—	—	2006年4月25日
						E号受益権	3	2011年3月15日	2013年3月15日	ソフトプレット	—	—	—	BBB-	—	—	—	—	2006年4月25日
2006年5月9日 (2006年4月25日)	ORIX-NRL信託11	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	139	1.05年	2012年9月3日	3ヶ月毎 パースル	—	—	Aaa	—	AAA	—	—	—	2006年4月25日
						B号受益権	18	2.57年	2012年9月3日	3ヶ月毎 パースル	—	—	Aa2	—	AA	—	—	—	2006年4月25日
						C号受益権	19	2.57年	2012年9月3日	3ヶ月毎 パースル	—	—	A2	—	A	—	—	—	2006年4月25日
						D号受益権	6	2.57年	2012年9月3日	3ヶ月毎 パースル	—	—	A3	—	A-	—	—	—	2006年4月25日
						X号受益権	182 (想定元本)	—	2012年9月3日	3ヶ月毎 パースル	—	—	Aaa	—	AAA	—	—	—	2006年4月25日
2006年5月9日 (2006年4月19日)	JLOC XXX信託	モルガン・スタンレー証券	モルガン・スタンレー証券 新生信託銀行	信託受益権	商業用不動産	A	2,256	1.3年	2014年4月	3ヶ月毎 パースル	AAA	—	Aaa	—	AAA	変動	0.27%	3ヶ月円LIBOR	2006年5月15日
						B	354	2.2年	2014年4月	3ヶ月毎 パースル	AA	—	Aa2	—	AA	変動	0.45%	3ヶ月円LIBOR	2006年5月15日
						C	373	2.2年	2014年4月	3ヶ月毎 パースル	A	—	A2	—	A	変動	0.60%	3ヶ月円LIBOR	2006年5月15日
						D	355	2.6年	2014年4月	3ヶ月毎 パースル	BBB	—	Baa2	—	BBB	変動	1.30%	3ヶ月円LIBOR	2006年5月15日
						X (10)	3,338 (想定元本)	—	—	—	AAA	—	Aaa	—	AAA	—	—	—	2006年5月15日
2006年5月9日 (2006年4月19日)	JLOC XXXサテライト信託	モルガン・スタンレー証券	モルガン・スタンレー証券 新生信託銀行	信託受益権	商業用不動産	サテライト1	83	—	2014年4月	3ヶ月毎 パースル	BB	—	Ba2	—	BB	—	—	—	2006年5月15日
						サテライト2	10	—	2014年4月	3ヶ月毎 パースル	BB	—	Ba2	—	BB	—	—	—	2006年5月15日
2006年5月11日 (2006年4月26日)	貸付債権担保第42回 住宅金融公庫債券	住宅金融公庫	野村證券(事務幹事) クレディ・スイス証券 ゴールドマン・サックス証券会社東京支店	国内公募債	住宅ローン債権	—	1,907	—	2041年5月10日	1ヶ月毎 パースル	—	—	—	AAA	AAA	2.34%	0.39%	1.96% JGB278回債	2006年4月26日

以 上