

案件の名称・発行体	当初格付 (注1)	通貨	当初発行金額 (百万)	裏付資産の種類	当初劣後比率	発行日	最終償還日	クーポンタイプ (固定/変動)	利率	レポートまたはプレスリリース (注2)	海外案件(Y/N) (注3)	公表格付基準 (注4)	現在格付	アウト ルック	回収率 見込み	格付日 (注5)
国内案件	◎	◎	◎	◎	(◎)	(◎)	◎	(◎)	○	(◎)						
海外案件	◎	◎	◎	◎	○	◎	◎	○	○	○						
(金融庁の開示項目は◎、開示推奨項目は○、H18.10.1以降発行の案件にかかる開示項目は(◎))																
【ABCP】*																
パーテックス・ファンディング・コーポレーション Pte Ltd	F1	JPY	100,000**	売掛債権、ローン、債券、 モーゲージ等	-	-	-	-	-	有-公表	Y		WDsf			09/19/2017
ホライゾン・ファンディング・コーポレーション	F1	JPY	900,000**	売掛債権、ローン、債券、 モーゲージ等	-	-	-	-	-	有-公表	Y	○	F1sf			04/26/2018
【ABS】																
Driver Japan five 第二信託受益権及び第二信託ABL	AAA sf	JPY	60,000	自動車ローン債権	6.5%	02/26/2016	06/28/2024	固定	0.19%	有-公表	N	○	AAA sf	安定的		02/06/2018
Driver Japan six 第二信託受益権及び第二信託ABL	AAA sf	JPY	60,000	自動車ローン債権	6.5%	02/27/2017	06/30/2025	固定	0.19%	有-公表	N	○	AAA sf	安定的		02/06/2018
Driver Japan seven 第二信託受益権及び第二信託ABL	AAA sf	JPY	55,000	自動車ローン債権	6.5%	02/27/2018	06/29/2026	固定	0.17%	有-公表	N	○	AAA sf	安定的		02/27/2018
Driver Japan eight 第二信託受益権及び第二信託ABL	AAA(EXP) sf	JPY	40,000	自動車ローン債権	6.5%	02/27/2019	06/28/2027	固定	未定	有-公表	N	○	AAA(EXP) sf	安定的		01/07/2019
OSCAR US 2017-1																
クラスA-1 ノート	F1+sf	USD	52.3	自動車ローン債権	85.0%	03/23/2017	04/10/2018	固定	1.18%	有-公表	Y		PIF sf			09/11/2017
クラスA-2a ノート	AAA sf	USD	90.6	自動車ローン債権	46.1%	03/23/2017	05/11/2020	固定	2.30%	有-公表	Y	○	AAA sf	安定的		03/02/2018
クラスA-2b ノート	AAA sf	USD	45.4	自動車ローン債権	46.1%	03/23/2017	05/11/2020	変動	1M米ドル LIBOR+0.80%	有-公表	Y	○	AAA sf	安定的		03/02/2018
クラスA-3 ノート	AAA sf	USD	66.2	自動車ローン債権	27.1%	03/23/2017	06/10/2021	固定	2.82%	有-公表	Y	○	AAA sf	安定的		03/02/2018
クラスA-4 ノート	AAA sf	USD	58.4	自動車ローン債権	10.4%	03/23/2017	05/10/2024	固定	3.30%	有-公表	Y	○	AAA sf	安定的		03/02/2018
OSCAR US 2017-2																
クラスA-1 ノート	F1+sf	USD	62.0	自動車ローン債権	86.7%	09/26/2017	10/10/2018	固定	1.45%	有-公表	Y		PIF sf			04/10/2018
クラスA-2a ノート	AAA sf	USD	89.3	自動車ローン債権	48.1%	09/26/2017	11/10/2020	固定	2.13%	有-公表	Y	○	AAA sf	安定的		08/28/2018
クラスA-2b ノート	AAA sf	USD	90.2	自動車ローン債権	48.1%	09/26/2017	11/10/2020	変動	1M米ドル LIBOR+0.65%	有-公表	Y	○	AAA sf	安定的		08/28/2018
クラスA-3 ノート	AAA sf	USD	92.1	自動車ローン債権	28.4%	09/26/2017	12/10/2021	固定	2.45%	有-公表	Y	○	AAA sf	安定的		08/28/2018
クラスA-4 ノート	AAA sf	USD	85.7	自動車ローン債権	10.0%	09/26/2017	12/10/2024	固定	2.76%	有-公表	Y	○	AAA sf	安定的		08/28/2018
OSCAR US 2018-1																
クラスA-1 ノート	F1+sf	USD	64.9	自動車ローン債権	86.7%	03/23/2018	04/10/2019	固定	2.16%	有-公表	Y		PIF sf			09/10/2018
クラスA-2a ノート	AAA sf	USD	120.3	自動車ローン債権	47.4%	03/23/2018	04/12/2021	固定	2.91%	有-公表	Y	○	AAA sf	安定的		03/23/2018
クラスA-2b ノート	AAA sf	USD	70.5	自動車ローン債権	47.4%	03/23/2018	04/12/2021	変動	1M米ドル LIBOR+0.49%	有-公表	Y	○	AAA sf	安定的		03/23/2018
クラスA-3 ノート	AAA sf	USD	96.8	自動車ローン債権	27.5%	03/23/2018	05/10/2022	固定	3.23%	有-公表	Y	○	AAA sf	安定的		03/23/2018
クラスA-4 ノート	AAA sf	USD	90.3	自動車ローン債権	8.9%	03/23/2018	05/12/2025	固定	3.50%	有-公表	Y	○	AAA sf	安定的		03/23/2018
OSCAR US 2018-2																
クラスA-1 ノート	F1+sf	USD	65.6	自動車ローン債権	86.5%	07/27/2018	08/12/2019	固定	2.43684%	有-公表	Y		PIF sf			01/10/2019
クラスA-2a ノート	AAA sf	USD	115.3	自動車ローン債権	48.5%	07/27/2018	08/10/2021	固定	3.15%	有-公表	Y	○	AAA sf	安定的		07/27/2018
クラスA-2b ノート	AAA sf	USD	70.1	自動車ローン債権	48.5%	07/27/2018	08/10/2021	変動	1M米ドル LIBOR+0.47%	有-公表	Y	○	AAA sf	安定的		07/27/2018
クラスA-3 ノート	AAA sf	USD	97.6	自動車ローン債権	28.5%	07/27/2018	09/12/2022	固定	3.39%	有-公表	Y	○	AAA sf	安定的		07/27/2018
クラスA-4 ノート	AAA sf	USD	92.2	自動車ローン債権	9.6%	07/27/2018	09/10/2025	固定	3.63%	有-公表	Y	○	AAA sf	安定的		07/27/2018

*上記格付の評価対象は、ストラクチャード・ファイナンスに区分される一方、金融商品取引業等に関する内閣府令第295条第3項第1号の規定に基づき「資産証券化商品」には該当しないものと考えられます。

** 現在の発行枠の金額(百万)

格付ウォッチ: ▲ポジティブ(格上げ方向)、▼ネガティブ(格下げ方向)、◆エボルビング(流動的)

注1) 発行前に予備格付が付与されていた場合であって、発行日以後に本格付が付与されたときには、当該本格付を表示。

注2) 金融庁の公表要件を満たすレポートまたはプレスリリースの公表状況を表す。

注3) 海外で発行され、裏付資産に本邦の資産を残高ベースで10%以上含まない証券化エクスポージャーについては「海外案件」と分類し、Yと表記。

注4) 公表格付基準欄の○は、パーゼル II に関し金融庁の定める「本邦における証券化取引に対する適格格付の公表要件」を充足していると当社が思料する案件。

△は弊社による開示が許された情報のみでは上記要件を充足しているかどうかを判断出来ない案件。

(但し、当社が上記要件を充足していると思料するものであっても、金融庁その他関係当局によりこれと異なる判断がなされる可能性があります。かかる可能性または金融庁の判断の結果について、当社はいかなる責任も負いません。)

注5) 格付日とは、当該格付に関する格付アクションを公表した日をいう(ただし、※が付されている場合は償還日)。

案件の名称・発行体	当初格付 (注1)	通貨	当初発行金額 (百万)	裏付資産の種類	当初劣後比率	発行日	最終償還日	クーポン・タイプ (固定/変動)	利率	レポートまたはプレスリリース (注2)	海外案件(Y/N) (注3)	公表格付基準 (注4)	現在格付	アウト ルック	回収率 見込み	格付日 (注5)
国内案件	◎		◎	◎	(◎)	(◎)	◎	(◎)	○	(◎)						
海外案件	◎		◎	◎	○	◎	◎	○	○	○						

(金融庁の開示項目は◎、開示推奨項目は○、H18.10.1以降発行の案件にかかる開示項目は(◎))

【CDO】

Aquarius + Investments plc Series 2015-4	A+sf	USD	150	レポ契約に基づき入れ替え可能な債券ポートフォリオ	-	09/10/2015	09/24/2018	非公表	非公表	有-公表	Y		PIFsf			09/24/2018
Eirles Two Limited Series 369	A+sf	USD	50	社債	-	08/16/2016	08/15/2046	ゼロ・クーポン	0%	有-公表	Y	○	A+sf	弱含み		05/11/2018
Eirles Two Limited Series 371	A+sf	USD	50	社債	-	08/16/2016	08/15/2046	ゼロ・クーポン	0%	有-公表	Y	○	A+sf	安定的		05/11/2018
GC Repackaging 2018-3 Ltd. クラスAノート	AAAsf	JPY	26,700	社債	-	05/30/2018	05/09/2031	変動	非公表	有-公表	Y	○	AAAsf	安定的		05/30/2018
GC Repackaging 2018-5 Ltd. クラスAノート	AAAsf	JPY	29,400	社債	-	07/13/2018	02/27/2031	変動	非公表	有-公表	Y	○	AAAsf	安定的		07/13/2018
GC Repackaging 2018-6 Ltd. クラスAノート	AAAsf	JPY	28,400	社債	-	08/31/2018	09/09/2031	変動	非公表	有-公表	Y	○	AAAsf	安定的		08/31/2018
HSBC Bank plc USD 20M CLNs due 2024 linked to the State of Israel																
USD 10M CLNs	Asf	USD	10	社債	-	10/07/2014	12/20/2024	変動	3Mドル LIBOR+1.7%	有-公表	Y	○	Asf	安定的		12/14/2018
Further Issue of USD 10M CLNs	Asf	USD	10	社債	-	04/25/2017	12/20/2024	変動	3Mドル LIBOR+1.7%	有-公表	Y	○	Asf	安定的		12/14/2018
MARC Finance Ltd Series M522	A-sf	JPY	2,000	社債	-	02/21/2012	02/13/2017	非公表	非公表	有-公表	Y		PIFsf			02/13/2017
MARC Finance Ltd Series M557	Asf	JPY	3,000	社債	-	08/14/2012	02/07/2017	非公表	非公表	有-公表	Y		PIFsf			02/07/2017
MARC Finance Ltd Series M578	A-sf	JPY	1,500	社債	-	04/02/2013	10/05/2017	非公表	非公表	有-公表	Y		PIFsf			10/05/2017
MARC Finance Ltd Series M584	BBB+sf	JPY	5,000	社債	-	05/16/2013	02/06/2018	非公表	非公表	有-公表	Y		PIFsf			02/06/2018
MARC Finance Ltd Series M629	BBB+sf	JPY	5,000	社債	-	03/10/2014	01/20/2021	非公表	非公表	有-公表	Y	○	BBB+sf	安定的		01/11/2019
STARTS (Ireland) plc Series 2015-3	Asf	CNY	320	社債	-	12/29/2015	11/21/2018	固定	非公表	有-公表	Y		PIFsf			11/21/2018

格付ウォッチ: ▲ポジティブ(格上げ方向)、▼ネガティブ(格下げ方向)、◆エボルピング(流動的)

注1) 発行前に予備格付が付与されていた場合であって、発行日以後に本格付が付与されたときには、当該本格付を表示。

注2) 金融庁の公表要件を満たすレポートまたはプレスリリースの公表状況を表す。

注3) 海外で発行され、裏付資産に本邦の資産を残高ベースで10%以上含まない証券化エクスポージャーについては「海外案件」と分類し、Yと表記。

注4) 公表格付基準欄の○は、パーゼルIIに関し金融庁の定める「本邦における証券化取引に対する適格格付の公表要件」を充足していると当社が思料する案件。

△は弊社による開示が許された情報のみでは上記要件を充足しているかどうかを判断出来ない案件。

(但し、当社が上記要件を充足していると思料するものであっても、金融庁その他関係当局よりこれと異なる判断がなされる可能性があります。かかる可能性または金融庁の判断の結果について、当社はいかなる責任も負いません。)

注5) 格付日とは、当該格付に関する格付アクションを公表した日をいう(ただし、※が付されている場合は償還日)。

案件の名称・発行体	当初格付 (注1)	通貨	当初発行 金額 (百万)	裏付資産の種類	当初劣 後比率	発行日	最終償還日	クーポンタイプ (固定/変動)	利率	レポートまたは プレスリリース (注2)	海外案件(Y/N) (注3)	公表格 付基準 (注4)	現在格付	アウト ルック	回収率 見込み	格付日 (注5)
国内案件	◎	◎	◎	◎	(◎)	(◎)	◎	(◎)	○	(◎)						
海外案件	◎	◎	◎	◎	○	◎	◎	○	○	○						
(金融庁の開示項目は◎、開示推奨項目は○、H18.10.1以降発行の案件にかかる開示項目は(◎))																
【CMBS】																
エル・マップ・ワン・ファンディング・リミテッド																
A号 ノート	AAA	JPY	17,540	アパートローン		05/22/2006	01/25/2038	変動		有-公表	N	○	AAAsf	安定的		10/10/2018
B号 ノート	AA	JPY	800	アパートローン		05/22/2006	01/25/2038	変動		有-公表	N	○	AAsf	安定的		10/10/2018
C号 ノート	A	JPY	580	アパートローン		05/22/2006	01/25/2038	変動		有-公表	N		PIFsf			03/26/2018
D号 ノート	BBB	JPY	390	アパートローン		05/22/2006	01/25/2038	変動		有-公表	N		PIFsf			02/25/2016 ※
J-NIM号 ノート	BBB	JPY	2,140	アパートローン		05/22/2006	01/25/2038	固定		有-公表	N		PIFsf			04/25/2014
ORIX APL 信託 2010-1																
A号 信託受益権	AAA	JPY	8,400	アパートローン	21.8%	07/16/2010	06/05/2041	変動		有-公表	N	○	AAAsf	安定的		11/09/2018
Cafes 1 (カフェワン) 信託																
A-1号 受益権	AAA	JPY	2,500	商業用不動産		07/21/2006	05/31/2018	固定		有-公表	N		PIFsf			07/29/2016
A-2号 受益権	AAA	JPY	31,300	商業用不動産		07/21/2006	05/31/2018	変動		有-公表	N		PIFsf			07/29/2016
B号 受益権	AA	JPY	6,400	商業用不動産		07/21/2006	05/31/2018	変動		有-公表	N		PIFsf			07/29/2016
C-1号 受益権	A	JPY	3,000	商業用不動産		07/21/2006	05/31/2018	固定		有-公表	N		PIFsf			07/29/2016
C-2号 受益権	A	JPY	3,400	商業用不動産		07/21/2006	05/31/2018	変動		有-公表	N		PIFsf			07/29/2016
D-1号 受益権	BBB	JPY	1,000	商業用不動産		07/21/2006	05/31/2018	固定		有-公表	N		PIFsf			07/29/2016
D-2号 受益権	BBB	JPY	5,600	商業用不動産		07/21/2006	05/31/2018	変動		有-公表	N		PIFsf			07/29/2016
X号 受益権 (信託配当のみ、想定元本)	AAA	JPY	53,200	商業用不動産		07/21/2006	05/31/2018	その他		有-公表	N		WDsf			11/12/2010
ディー・ティー・シーワン特定目的会社																
A-1号 変動利付債	AAA	JPY	500	アパートローン		11/28/2002	11/20/2034	変動		有-公表	N		PIFsf			03/21/2017
A-2号 変動利付債	AAA	JPY	4,400	アパートローン		11/28/2002	11/20/2034	変動		有-公表	N		PIFsf			03/21/2017
A-3号 変動利付債	AAA	JPY	20	アパートローン		11/28/2002	11/20/2034	変動		有-公表	N		PIFsf			03/21/2017
B号 変動利付債	AA	JPY	320	アパートローン		11/28/2002	11/20/2034	変動		有-公表	N	○	AAAsf	安定的		08/07/2018
C号 変動利付債	A	JPY	180	アパートローン		11/28/2002	11/20/2034	変動		有-公表	N	○	AA+sf	安定的		08/07/2018
D号 変動利付債	BBB	JPY	320	アパートローン		11/28/2002	11/20/2034	変動		有-公表	N	○	A+sf	安定的		08/07/2018
E号 変動利付債	BB	JPY	350	アパートローン		11/28/2002	11/20/2034	変動		有-公表	N	○	BBsf	安定的		08/07/2018
X号 社債 (利息のみ、想定元本)	AAA	JPY	6,312	アパートローン		11/28/2002	11/20/2034	その他		有-公表	N		WDsf			11/04/2010
ディー・ティー・シートゥーファンディング・リミテッド																
A号 変動利付ノート	AAA	JPY	7,560	アパートローン		07/23/2003	06/25/2035	変動		有-公表	N		PIFsf			08/25/2016
B号 変動利付ノート	AA	JPY	470	アパートローン		07/23/2003	06/25/2035	変動		有-公表	N		PIFsf			02/26/2018
C号 変動利付ノート	A	JPY	280	アパートローン		07/23/2003	06/25/2035	変動		有-公表	N	○	AAAsf	安定的		08/07/2018
D号 変動利付ノート	BBB	JPY	380	アパートローン		07/23/2003	06/25/2035	変動		有-公表	N	○	AAsf	安定的		08/07/2018
E号 変動利付ノート	BB	JPY	850	アパートローン		07/23/2003	06/25/2035	変動		有-公表	N	○	BBsf	安定的		08/07/2018
J号 変動利付ノート	BBB	JPY	8,690	アパートローン		07/23/2003	06/25/2035	変動		有-公表	N	○	AAsf	安定的		08/07/2018
X号 ノート (利息のみ、想定元本)	AAA	JPY	9,450	アパートローン		07/23/2003	06/25/2035	その他		有-公表	N		WDsf			11/04/2010

格付ウォッチ: ▲ポジティブ(格上げ方向)、▼ネガティブ(格下げ方向)、◆エボルビング(流動的)

注1) 発行前に予備格付が付与されていた場合であって、発行日以後に本格付が付与されたときには、当該本格付を表示。

注2) 金融庁の公表要件を満たすレポートまたはプレスリリースの公表状況を表す。

注3) 海外で発行され、裏付資産に本邦の資産を残高ベースで10%以上含まない証券化エクスポージャーについては「海外案件」と分類し、Yと表記。

注4) 公表格付基準欄の○は、バーゼル II に関し金融庁の定める「本邦における証券化取引に対する適格格付の公表要件」を充足していると当社が思料する案件。

△は弊社による開示が許された情報のみでは上記要件を充足しているかどうかを判断出来ない案件。

(但し、当社が上記要件を充足していると思料するものであっても、金融庁その他関係当局によりこれと異なる判断がなされる可能性があります。かかる可能性または金融庁の判断の結果について、当社はいかなる責任も負いません。)

注5) 格付日とは、当該格付に関する格付アクションを公表した日をいう(ただし、※が付されている場合は償還日)。

案件の名称・発行体	当初格付 (注1)	通貨	当初発行金額 (百万)	裏付資産の種類	当初劣後比率	発行日	最終償還日	クーポンタイプ (固定/変動)	利率	レポートまたはプレスリリース (注2)	海外案件(Y/N) (注3)	公表格付基準 (注4)	現在格付	アウト ルック	回収率 見込み	格付日 (注5)
国内案件	◎	◎	◎	◎	(◎)	(◎)	◎	(◎)	○	(◎)						
海外案件	◎	◎	◎	◎	○	◎	◎	○	○	○						

(金融庁の開示項目は◎、開示推奨項目は○、H18.10.1以降発行の案件にかかる開示項目は(◎))

【CMBS】

ディー・ティー・シー・スリー・ファンディング・リミテッド

A-1号 ノート	AAA	JPY	8,220	アパートローン		02/24/2004	02/25/2036	変動		有-公表	N		PIFsf			10/25/2016
A-2号 ノート	AAA	JPY	5,610	アパートローン		02/24/2004	02/25/2036	変動		有-公表	N		PIFsf			10/25/2016
B号 ノート	AA	JPY	870	アパートローン		02/24/2004	02/25/2036	変動		有-公表	N		PIFsf			12/27/2017
C号 ノート	A	JPY	540	アパートローン		02/24/2004	02/25/2036	変動		有-公表	N	○	AAAsf	安定的		08/07/2018
D号 ノート	BBB	JPY	690	アパートローン		02/24/2004	02/25/2036	変動		有-公表	N	○	AAsf	安定的		08/07/2018
E号 ノート	BB	JPY	776	アパートローン		02/24/2004	02/25/2036	変動		有-公表	N	○	BBsf	安定的		08/07/2018
X号 ノート (利息のみ、想定元本)	AAA	JPY	10,290	アパートローン		02/24/2004	02/25/2036	その他		有-公表	N		WDsf			11/04/2010

ディー・ティー・シー・フォー・ファンディング・リミテッド

A-1号 変動利付ノート	AAA	JPY	11,440	アパートローン		11/18/2004	11/25/2036	変動		有-公表	N	○	AAAsf	安定的		08/07/2018
A-2号 変動利付ノート	AAA	JPY	5,720	アパートローン		11/18/2004	11/25/2036	変動		有-公表	N	○	AAAsf	安定的		08/07/2018
B号 変動利付ノート	AA	JPY	840	アパートローン		11/18/2004	11/25/2036	変動		有-公表	N	○	AAsf	安定的		08/07/2018
C号 変動利付ノート	A	JPY	870	アパートローン		11/18/2004	11/25/2036	変動		有-公表	N		PIFsf			08/28/2018
D号 変動利付ノート	BBB	JPY	840	アパートローン		11/18/2004	11/25/2036	変動		有-公表	N		PIFsf			03/27/2017
E号 変動利付ノート	BB	JPY	750	アパートローン		11/18/2004	11/25/2036	変動		有-公表	N		PIFsf			03/25/2015
X号 ノート (利息のみ、想定元本)	AAA	JPY	14,132	アパートローン		11/18/2004	11/25/2036	その他		有-公表	N		WDsf			11/04/2010

ディー・ティー・シー・ファイブ・ファンディング・リミテッド

A号 変動利付ノート	AAA	JPY	16,830	アパートローン		03/08/2005	03/25/2037	変動		有-公表	N	○	AAAsf	安定的		08/07/2018
B号 変動利付ノート	AA	JPY	840	アパートローン		03/08/2005	03/25/2037	変動		有-公表	N		PIFsf			10/25/2018
C号 変動利付ノート	A	JPY	840	アパートローン		03/08/2005	03/25/2037	変動		有-公表	N		PIFsf			10/25/2017
D号 変動利付ノート	BBB	JPY	840	アパートローン		03/08/2005	03/25/2037	変動		有-公表	N		PIFsf			10/25/2016
E号 変動利付ノート	BB	JPY	720	アパートローン		03/08/2005	03/25/2037	変動		有-公表	N		PIFsf			05/26/2015
X号 ノート (利息のみ、想定元本)	AAA	JPY	20,795	アパートローン		03/08/2005	03/25/2037	その他		有-公表	N		WDsf			11/04/2010

ディー・ティー・シー・シックス・ファンディング・リミテッド

A号 変動利付ノート	AAA	JPY	24,610	アパートローン		10/25/2005	07/27/2037	変動		有-公表	N	○	AAAsf	安定的		08/07/2018
B号 変動利付ノート	AA	JPY	1,200	アパートローン		10/25/2005	07/27/2037	変動		有-公表	N	○	AAsf	安定的		08/07/2018
C号 変動利付ノート	A	JPY	1,260	アパートローン		10/25/2005	07/27/2037	変動		有-公表	N		PIFsf			12/27/2017
D号 変動利付ノート	BBB	JPY	1,000	アパートローン		10/25/2005	07/27/2037	変動		有-公表	N		PIFsf			06/27/2016 ※
E号 変動利付ノート	BB	JPY	1,100	アパートローン		10/25/2005	07/27/2037	変動		有-公表	N		PIFsf			06/25/2014
X号 ノート (利息のみ、想定元本)	AAA	JPY	30,014	アパートローン		10/25/2005	07/27/2037	その他		有-公表	N		WDsf			11/04/2010

格付ウォッチ: ▲ポジティブ(格上げ方向)、▼ネガティブ(格下げ方向)、◆エボルビング(流動的)

注1) 発行前に予備格付が付与されていた場合であって、発行日以後に本格付が付与されたときには、当該本格付を表示。

注2) 金融庁の公表要件を満たすレポートまたはプレスリリースの公表状況を表す。

注3) 海外で発行され、裏付資産に本邦の資産を残高ベースで10%以上含まない証券化エクスポージャーについては「海外案件」と分類し、Yと表記。

注4) 公表格付基準欄の○は、バーゼルⅡに関し金融庁の定める「本邦における証券化取引に対する適格格付の公表要件」を充足していると当社が思料する案件。

△は弊社による開示が許された情報のみでは上記要件を充足しているかどうかを判断出来ない案件。

(但し、当社が上記要件を充足していると思料するものであっても、金融庁その他関係当局によりこれと異なる判断がなされる可能性があります。かかる可能性または金融庁の判断の結果について、当社はいかなる責任も負いません。)

注5) 格付日とは、当該格付に関する格付アクションを公表した日をいう(ただし、※が付されている場合は償還日)。

案件の名称・発行体	当初格付 (注1)	通貨	当初発行金額 (百万)	裏付資産の種類	当初劣後比率	発行日	最終償還日	クーポンタイプ (固定/変動)	利率	レポートまたはプレスリリース (注2)	海外案件(Y/N) (注3)	公表格付基準 (注4)	現在格付	アウト ルック	回収率 見込み	格付日 (注5)
国内案件	◎	◎	◎	◎	(◎)	(◎)	◎	(◎)	○	(◎)						
海外案件	◎	◎	◎	◎	○	◎	◎	○	○	○						

(金融庁の開示項目は◎、開示推奨項目は○、H18.10.1以降発行の案件にかかる開示項目は(◎))

【CMBS】

ディー・ティー・シー・セブン・ファンディング・リミテッド

A号 変動利付ノート	AAA	JPY	21,780	アパートローン	14.4%	11/15/2006	02/25/2038	変動		有-公表	N	○	AAAsf	安定的		08/07/2018
B号 変動利付ノート	AA	JPY	1,200	アパートローン	9.7%	11/15/2006	02/25/2038	変動		有-公表	N		PIFsf			08/28/2018
C号 変動利付ノート	A	JPY	1,060	アパートローン	5.5%	11/15/2006	02/25/2038	変動		有-公表	N		PIFsf			06/26/2017
D号 変動利付ノート	BBB	JPY	890	アパートローン	2.0%	11/15/2006	02/25/2038	変動		有-公表	N		PIFsf			08/25/2015
N号 固定利付ノート	BBB	JPY	2,350	アパートローン	0.0%	11/15/2006	02/25/2038	固定		有-公表	N		PIFsf			06/25/2013

ディー・ティー・シー・エイト・ファンディング・リミテッド

A号 ノート	AAA	JPY	35,000	アパートローン	13.2%	03/06/2007	11/25/2038	変動		有-公表	N	○	AAAsf	安定的		08/07/2018
B号 ノート	AA	JPY	1,780	アパートローン	8.8%	03/06/2007	11/25/2038	変動		有-公表	N	○	AAsf	安定的		08/07/2018
C号 ノート	A	JPY	1,620	アパートローン	4.8%	03/06/2007	11/25/2038	変動		有-公表	N	○	Asf	安定的		08/07/2018
D号 ノート	BBB	JPY	1,210	アパートローン	1.8%	03/06/2007	11/25/2038	変動		有-公表	N		PIFsf			12/27/2017
E号 ノート	BB	JPY	240	アパートローン	1.2%	03/06/2007	11/25/2038	変動		有-公表	N		PIFsf			07/25/2014
N号 ノート	BBB	JPY	3,900	アパートローン	0.0%	03/06/2007	11/25/2038	固定		有-公表	N		PIFsf			02/27/2017

レパード・トゥー・ファンディング・リミテッド

A-1号 ノート	AAA	JPY	7,830	アパートローン		08/30/2004	08/25/2036	変動		有-非公表	N	○	AAAsf	安定的		10/10/2018
A-2号 ノート	AAA	JPY	7,830	アパートローン		08/30/2004	08/25/2036	変動		有-非公表	N	○	AAAsf	安定的		10/10/2018
B号 ノート	AA	JPY	520	アパートローン		08/30/2004	08/25/2036	変動		有-非公表	N	○	AAsf	安定的		10/10/2018
C号 ノート	A	JPY	520	アパートローン		08/30/2004	08/25/2036	変動		有-非公表	N	○	Asf	安定的		10/10/2018
D号 ノート	BBB	JPY	540	アパートローン		08/30/2004	08/25/2036	変動		有-非公表	N	○	BBsf	安定的		10/10/2018
E号 ノート	BBB-	JPY	41	アパートローン		08/30/2004	08/25/2036	変動		有-非公表	N	○	BBsf	安定的		10/10/2018
X号 ノート (利息のみ、想定元本)	AAA	JPY	8,850	アパートローン		08/30/2004	-	-		有-非公表	N		WDsf			12/08/2010

【RMBS】

LHLトラスト 2000-1

変動利付優先受益権	AAA	JPY	11,000	住宅ローン債権	レポート参照	04/20/2000	08/20/2034	変動	非公表	有-公表	N		PIFsf			12/21/2015
-----------	-----	-----	--------	---------	--------	------------	------------	----	-----	------	---	--	-------	--	--	------------

エル・スターズ・ワン・ファンディング・リミテッド

A号 変動利付債	AAA	JPY	8,740	住宅ローン債権	12.0%	11/29/2006	10/27/2043	変動	非公表	有-公表	N	○	AAAsf	安定的		08/30/2018
B号 変動利付債	AA	JPY	450	住宅ローン債権	7.5%	11/29/2006	10/27/2043	変動	非公表	有-公表	N		PIFsf			04/27/2018
C号 変動利付債	A	JPY	300	住宅ローン債権	4.5%	11/29/2006	10/27/2043	変動	非公表	有-公表	N		PIFsf			11/28/2016
D号 変動利付債	BBB+	JPY	150	住宅ローン債権	3.0%	11/29/2006	10/27/2043	変動	非公表	有-公表	N		PIFsf			06/29/2015
E号 ゼロ・クーポン債	BBB	JPY	100	住宅ローン債権	2.0%	11/29/2006	10/27/2043	ゼロ・クーポン	0%	有-公表	N	○	AA-sf	安定的		08/30/2018
N-1号 固定利付債	BBB+	JPY	1,100	住宅ローン債権	0.0%	11/29/2006	10/27/2043	固定	非公表	有-公表	N		PIFsf			11/27/2012
N-2号 ゼロ・クーポン債	BBB	JPY	140	住宅ローン債権	0.0%	11/29/2006	10/27/2043	ゼロ・クーポン	0%	有-公表	N		PIFsf			12/27/2013

格付ウォッチ: ▲ポジティブ(格上げ方向)、▼ネガティブ(格下げ方向)、◆エボルビング(流動的)

注1) 発行前に予備格付が付与されていた場合であって、発行日以後に本格付が付与されたときには、当該本格付を表示。

注2) 金融庁の公表要件を満たすレポートまたはプレスリリースの公表状況を表す。

注3) 海外で発行され、裏付資産に本邦の資産を残高ベースで10%以上含まない証券化エクスポージャーについては「海外案件」と分類し、Yと表記。

注4) 公表格付基準欄の○は、パーゼルIIに関し金融庁の定める「本邦における証券化取引に対する適格格付の公表要件」を充足していると当社が思料する案件。

△は弊社による開示が許された情報のみでは上記要件を充足しているかどうかを判断出来ない案件。

(但し、当社が上記要件を充足していると思料するものであっても、金融庁その他関係当局によりこれと異なる判断がなされる可能性があります。かかる可能性または金融庁の判断の結果について、当社はいかなる責任も負いません。)

注5) 格付日とは、当該格付に関する格付アクションを公表した日をいう(ただし、※が付されている場合は償還日)。

案件の名称・発行体	当初格付 (注1)	通貨	当初発行金額 (百万)	裏付資産の種類	当初劣後比率	発行日	最終償還日	クーポンタイプ (固定/変動)	利率	レポートまたは プレスリリース (注2)	海外案件(Y/N) (注3)	公表格付基準 (注4)	現在格付	アウト ルック	回収率 見込み	格付日 (注5)
国内案件	◎		◎	◎	(◎)	(◎)	◎	(◎)	○	(◎)						
海外案件	◎		◎	◎	○	◎	◎	○	○	○						

(金融庁の開示項目は◎、開示推奨項目は○、H18.10.1以降発行の案件にかかる開示項目は(◎))

【RMBS】

ドリームズ・ファンディング・コーポレーション

A1号 固定利付債	AAA	JPY	4,200	住宅ローン債権		08/08/2001	07/25/2030	固定	非公表	有-公表	N		PIF			09/26/2005
A2号 固定利付債	AAA	JPY	2,500	住宅ローン債権		08/08/2001	07/25/2030	固定	非公表	有-公表	N	○	AAAsf	安定的		11/26/2018
L1号 変動利付債	AAA	JPY	32,100	住宅ローン債権		08/08/2001	07/25/2030	変動	1M円LIBOR+α	有-公表	N		PIF			12/25/2007
L2号 変動利付債	AAA	JPY	23,700	住宅ローン債権	レポート参照	08/08/2001	07/25/2030	変動	1M円LIBOR+α	有-公表	N		PIFsf			01/25/2017
L3号 変動利付債	AAA	JPY	6,500	住宅ローン債権		08/08/2001	07/25/2030	変動	1M円LIBOR+α	有-公表	N	○	AAAsf	安定的		11/26/2018
M1号 変動利付債	BBB	JPY	2,700	住宅ローン債権		08/08/2001	07/25/2030	変動	1M円LIBOR+α	有-公表	N		PIF			07/27/2009
M2号 変動利付債	BBB	JPY	1,800	住宅ローン債権		08/08/2001	07/25/2030	変動	1M円LIBOR+α	有-公表	N	○	Asf	安定的		11/26/2018

ハイdra・ツー・ファンディング・コーポレーション

S1号 変動利付債	AAA	JPY	76,000	住宅ローン債権		10/31/2003	08/16/2038	変動	非公表	有-公表	N		PIFsf			01/16/2017
S2号 固定利付債	AAA	JPY	9,000	住宅ローン債権	レポート参照	10/31/2003	08/16/2038	固定	非公表	有-公表	N		PIFsf			09/15/2010
S3号 固定利付債	AAA	JPY	7,000	住宅ローン債権		10/31/2003	08/16/2038	固定	非公表	有-公表	N		PIFsf			01/16/2017
J号 変動利付債	BBB	JPY	5,000	住宅ローン債権		10/31/2003	08/16/2038	変動	非公表	有-公表	N		PIFsf			01/16/2017

ハイdra・スリー・ファンディング・コーポレーション

S1号 変動利付債	AAA	JPY	67,600	住宅ローン債権	レポート参照	03/30/2004	10/17/2039	変動	非公表	有-公表	N		PIF			11/15/2016
S2号 固定利付債	AAA	JPY	5,200	住宅ローン債権		03/30/2004	10/17/2039	固定	非公表	有-公表	N		PIF			11/15/2016
J号 変動利付債	BBB	JPY	700	住宅ローン債権		03/30/2004	10/17/2039	変動	非公表	有-公表	N		PIF			11/15/2016

ハイdra・フォー・ファンディング・コーポレーション

第1回無担保社債	AAA	JPY	141,600	住宅ローン債権	レポート参照	10/29/2004	10/17/2039	変動	1M円LIBOR+α	有-公表	N		PIF			11/15/2016
----------	-----	-----	---------	---------	--------	------------	------------	----	------------	------	---	--	-----	--	--	------------

ハイdra・ファイブ・ファンディング・コーポレーション

S1号 変動利付債	AAA	JPY	70,300	住宅ローン債権	レポート参照	06/30/2005	07/18/2045	変動	1M円LIBOR+α	有-公表	N		PIFsf			04/17/2017
S2号 固定利付債	AAA	JPY	13,400	住宅ローン債権		06/30/2005	07/18/2045	固定	非公表	有-公表	N		PIFsf			10/17/2016

格付ウォッチ: ▲ポジティブ(格上げ方向)、▼ネガティブ(格下げ方向)、◆エボルビング(流動的)

注1) 発行前に予備格付が付与されていた場合であって、発行日以後に本格付が付与されたときには、当該本格付を表示。

注2) 金融庁の公表要件を満たすレポートまたはプレスリリースの公表状況を表す。

注3) 海外で発行され、裏付資産に本邦の資産を残高ベースで10%以上含まない「証券化エクスポージャーについては「海外案件」と分類し、Yと表記。

注4) 公表格付基準欄の○は、パーセルⅡに関し金融庁の定める「本邦における証券化取引に対する適格格付の公表要件」を充足していると当社が思料する案件。

△は弊社による開示が許された情報のみでは上記要件を充足しているかどうかを判断出来ない案件。

(但し、当社が上記要件を充足していると思料するものであっても、金融庁その他関係当局によりこれと異なる判断がなされる可能性があります。かかる可能性または金融庁の判断の結果について、当社はいかなる責任も負いません。)

注5) 格付日とは、当該格付に関する格付アクションを公表した日をいう(ただし、※が付されている場合は償還日)。

著作権©2019年フィッチ・レーティングス・インク、フィッチ・レーティングス・リミテッド及びその子会社(33 Whitehall Street, NY, NY 10004), Telephone: Tokyo 81-3-3288-2628, New York 1-800-753-4824/1-212-908-0500, Fax: Tokyo 81-3-3288-2627, New York 1-212-480-4435.

本資料の一部又は全部を、フィッチの同意を得ることなしに複製又は頒布することは許されません。

格付を付与し維持するうえで、フィッチは、発行体、引当会社及びその他フィッチが信頼に足る判断する情報源から入手する、事実に関する情報に依拠しています。フィッチは、格付方法に則り依頼する事実に関する情報について、合理的な範囲での調査を行い、当該証券に関して又は当該法域において利用可能な範囲内で独立した情報源による合理的な検証を行います。

フィッチの格付利用者は、事実に関する調査の強化又は第三者検証のいずれによっても、フィッチが格付に関して提供する情報のすべてが正確かつ完全であることを確保することはできないことを、理解すべきです。

さらに、格付は本質的に将来を見据えたものであり、事実として検証できない将来の事象に関する仮定や予測を含みます。その結果、格付は、現時点の事象を検証するにもかかわらず、格付付又は照看時に予想されない将来の事象や状況に影響されることがあります。

本資料に記載された情報は、いかなる表明もしくは保証なしに、「あるがまま」に提供されるものです。フィッチの格付は、証券の信用力に関する当社の意見であり、いかなる証券の購入、売却又は保有の推奨ではありません。