

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	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		12/17/2021
【ABS】															
Driver Japan five 第二信託受益権及び第二信託ABL	AAAsf	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		PIFsf		09/30/2019
Driver Japan six 第二信託受益権及び第二信託ABL	AAAsf	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		PIFsf		04/28/2021
Driver Japan seven 第二信託受益権及び第二信託ABL	AAAsf	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		PIFsf		04/28/2022
Driver Japan eight 第二信託受益権及び第二信託ABL	AAAsf	JPY	65,000	自動車ローン債権	6.5%	02/27/2019	06/28/2027	固定	0.10%	有-公表	N	○	AAAsf	安定的	11/11/2021
Driver Japan nine 第二信託受益権及び第二信託ABL	AAAsf	JPY	60,000	自動車ローン債権	6.5%	02/27/2020	06/28/2028	固定	0.10%	有-公表	N	○	AAAsf	安定的	11/11/2021
Driver Japan ten 第二信託受益権及び第二信託ABL	AAAsf	JPY	60,000	自動車ローン債権	6.5%	02/25/2021	06/28/2029	固定	0.10%	有-公表	N	○	AAAsf	安定的	11/11/2021
Driver Japan eleven 第二信託受益権及び第二信託ABL	AAAsf	JPY	55,000	自動車ローン債権	6.5%	02/25/2022	06/28/2030	固定	0.11%	有-公表	N	○	AAAsf	安定的	02/25/2022
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		PIFsf		09/11/2017
クラスA-2a ノート	AAAsf	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		PIFsf		04/10/2019
クラスA-2b ノート	AAAsf	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		PIFsf		04/10/2019
クラスA-3 ノート	AAAsf	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		PIFsf		05/11/2020
クラスA-4 ノート	AAAsf	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		PIFsf		04/12/2021
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		有-公表	Y		PIFsf		04/10/2018
クラスA-2a ノート	AAAsf	USD	89.3	自動車ローン債権	48.1%	09/26/2017	11/10/2020	固定		有-公表	Y		PIFsf		10/10/2019
クラスA-2b ノート	AAAsf	USD	90.2	自動車ローン債権	48.1%	09/26/2017	11/10/2020	変動		有-公表	Y		PIFsf		10/10/2019
クラスA-3 ノート	AAAsf	USD	92.1	自動車ローン債権	28.4%	09/26/2017	12/10/2021	固定		有-公表	Y		PIFsf		11/10/2020
クラスA-4 ノート	AAAsf	USD	85.7	自動車ローン債権	10.0%	09/26/2017	12/10/2024	固定		有-公表	Y	○	AAAsf	安定的	11/16/2021
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		有-公表	Y		PIFsf		09/10/2018
クラスA-2a ノート	AAAsf	USD	120.3	自動車ローン債権	47.4%	03/23/2018	04/12/2021	固定		有-公表	Y		PIFsf		03/10/2020
クラスA-2b ノート	AAAsf	USD	70.5	自動車ローン債権	47.4%	03/23/2018	04/12/2021	変動		有-公表	Y		PIFsf		03/10/2020
クラスA-3 ノート	AAAsf	USD	96.8	自動車ローン債権	27.5%	03/23/2018	05/10/2022	固定		有-公表	Y		PIFsf		04/12/2021
クラスA-4 ノート	AAAsf	USD	90.3	自動車ローン債権	8.9%	03/23/2018	05/12/2025	固定		有-公表	Y	○	AAAsf	安定的	11/16/2021
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		有-公表	Y		PIFsf		01/10/2019
クラスA-2a ノート	AAAsf	USD	115.3	自動車ローン債権	48.5%	07/27/2018	08/10/2021	固定		有-公表	Y		PIFsf		07/10/2020
クラスA-2b ノート	AAAsf	USD	70.1	自動車ローン債権	48.5%	07/27/2018	08/10/2021	変動		有-公表	Y		PIFsf		07/10/2020
クラスA-3 ノート	AAAsf	USD	97.6	自動車ローン債権	28.5%	07/27/2018	09/12/2022	固定		有-公表	Y		PIFsf		08/10/2021
クラスA-4 ノート	AAAsf	USD	92.2	自動車ローン債権	9.6%	07/27/2018	09/10/2025	固定		有-公表	Y	○	AAAsf	安定的	11/16/2021

*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)

UCO: 格付基準変更に伴う見直し

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示。

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	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(◎))															
【ABS】															
OSCAR US 2019-1															
クラスA-1 ノート	F1+sf	USD	69.2	自動車ローン債権	86.5%	03/26/2019	04/10/2020	固定		有-公表	Y		PIFsf		09/10/2019
クラスA-2 ノート	AAAsf	USD	195.1	自動車ローン債権	48.4%	03/26/2019	04/11/2022	固定		有-公表	Y		PIFsf		03/10/2021
クラスA-3 ノート	AAAsf	USD	102.5	自動車ローン債権	28.4%	03/26/2019	05/10/2023	固定		有-公表	Y		PIFsf		04/11/2022
クラスA-4 ノート	AAAsf	USD	97.1	自動車ローン債権	9.5%	03/26/2019	05/11/2026	固定		有-公表	Y	○	AAAsf	安定的	11/16/2021
OSCAR US 2019-2															
クラスA-1 ノート	F1+sf	USD	72.0	自動車ローン債権	86.1%	07/30/2019	08/10/2020	固定		有-公表	Y		PIFsf		01/10/2020
クラスA-2 ノート	AAAsf	USD	194.8	自動車ローン債権	48.6%	07/30/2019	08/10/2022	固定		有-公表	Y		PIFsf		07/12/2021
クラスA-3 ノート	AAAsf	USD	101.6	自動車ローン債権	29.0%	07/30/2019	09/11/2023	固定		有-公表	Y	○	AAAsf	安定的	11/16/2021
クラスA-4 ノート	AAAsf	USD	97.9	自動車ローン債権	10.1%	07/30/2019	09/10/2026	固定		有-公表	Y	○	AAAsf	安定的	11/16/2021
OSCAR US 2020-1															
クラスA-1 ノート	F1+(EXP)sf			自動車ローン債権						有-公表	Y		WDsf		03/25/2020
クラスA-2 ノート	AAA(EXP)sf			自動車ローン債権						有-公表	Y		WDsf		03/25/2020
クラスA-3 ノート	AAA(EXP)sf			自動車ローン債権						有-公表	Y		WDsf		03/25/2020
クラスA-4 ノート	AAA(EXP)sf			自動車ローン債権						有-公表	Y		WDsf		03/25/2020
OSCAR US 2021-1															
クラスA-1 ノート	F1+sf	USD	74.7	自動車ローン債権	86.9%	02/26/2021	03/10/2022	固定		有-公表	Y		PIFsf		08/10/2021
クラスA-2 ノート	AAAsf	USD	212.7	自動車ローン債権	49.6%	02/26/2021	03/11/2024	固定		有-公表	Y	○	AAAsf	安定的	11/16/2021
クラスA-3 ノート	AAAsf	USD	116.3	自動車ローン債権	29.2%	02/26/2021	04/10/2025	固定		有-公表	Y	○	AAAsf	安定的	11/16/2021
クラスA-4 ノート	AAAsf	USD	113.5	自動車ローン債権	9.3%	02/26/2021	04/10/2028	固定		有-公表	Y	○	AAAsf	安定的	11/16/2021
OSCAR US 2021-2															
クラスA-1 ノート	F1+sf	USD	78.1	自動車ローン債権	84.7%	07/27/2021	08/10/2022	固定		有-公表	Y		PIFsf		01/10/2022
クラスA-2 ノート	AAAsf	USD	198.1	自動車ローン債権	46.0%	07/27/2021	08/12/2024	固定		有-公表	Y	○	AAAsf	安定的	11/16/2021
クラスA-3 ノート	AAAsf	USD	90.9	自動車ローン債権	28.2%	07/27/2021	09/10/2025	固定		有-公表	Y	○	AAAsf	安定的	11/16/2021
クラスA-4 ノート	AAAsf	USD	89.9	自動車ローン債権	10.7%	07/27/2021	09/11/2028	固定		有-公表	Y	○	AAAsf	安定的	11/16/2021
OSCAR US 2022-1															
クラスA-1 ノート	F1+sf	USD	60.5	自動車ローン債権	87.2%	02/22/2022	03/10/2023	固定		有-公表	Y	○	F1+sf		02/22/2022
クラスA-2 ノート	AAAsf	USD	171.0	自動車ローン債権	51.0%	02/22/2022	03/10/2025	固定		有-公表	Y	○	AAAsf	安定的	02/22/2022
クラスA-3 ノート	AAAsf	USD	101.9	自動車ローン債権	29.4%	02/22/2022	04/10/2026	固定		有-公表	Y	○	AAAsf	安定的	02/22/2022
クラスA-4 ノート	AAAsf	USD	101.9	自動車ローン債権	7.9%	02/22/2022	04/10/2029	固定		有-公表	Y	○	AAAsf	安定的	02/22/2022
シルバー・アロー・ジャパン シリーズ2021-1	AAAsf	JPY	87,000	自動車ローン債権	6.0%	03/25/2021	07/28/2028	固定	0.13%	有-公表	N	○	AAAsf	安定的	02/21/2022

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)

UCO: 格付基準変更に伴う見直し

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判断する案件。

△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	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(◎))

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	格付日 (注5)
Ascent Finance Limited Series 2019-1032	A-sf	EUR	15	社債	-	10/29/2019	07/12/2047	固定	1.190%	有-公表	Y	○	BBB+sf	安定的	05/26/2022
Ascent Finance Limited Series 2021-1900	A-sf	AUD	50	社債	-	11/19/2021	02/06/2043	固定		有-公表	Y	○	BBB+sf	安定的	05/26/2022
Aquarius + Investments plc Series 2015-4	A+sf	USD	150	レボ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		PIFsf		02/21/2020
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		PIFsf		02/21/2020
GC Repackaging 2018-3 Ltd. クラスA ノート	AAA sf	JPY	26,700	社債	-	05/30/2018	05/09/2031	変動	非公表	有-公表	Y	○	AAA sf	安定的	01/14/2022
GC Repackaging 2018-5 Ltd. クラスA ノート	AAA sf	JPY	29,400	社債	-	07/13/2018	02/27/2031	変動	非公表	有-公表	Y	○	AAA sf	安定的	03/02/2022
GC Repackaging 2018-6 Ltd. クラスA ノート	AAA sf	JPY	28,400	社債	-	08/31/2018	09/09/2031	変動	非公表	有-公表	Y	○	AAA sf	安定的	04/13/2022
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	弱含み	03/23/2021
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	弱含み	03/23/2021
M&T INVESTMENTS PTE. LTD. 109.0百万シンガポールドル 2.850% 担保付サステナビリティ・リンク クラスA1ノート 2026年3月25日満期(シリーズ001クラスA1ノート)	AAA sf	SGD	109.0	車両ポートフォリオの車両所有権 証券及び追加車両登録料	-	04/05/2022	03/25/2026	固定	2.850%	有-公表	Y	○	AAA sf	安定的	04/05/2022
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		PIFsf		01/22/2021
SPIRE Series 2020-2017	A+sf	CAD	151	社債	-	11/16/2020	11/20/2025	固定	非公表	有-公表	Y	○	A+sf	安定的	10/05/2021
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

*** 本債券に対する格付の主任格付アナリストがフィッチ・レーティングス・ジャパン株式会社(当社)のアナリストからグループ内他法人所属アナリストに変更されたことにより、2021年3月23日以降、当該格付は、当社が維持・管理する格付には該当しませんが、引き続き当社グループ内他法人が従来同様モニタリング及び更新を実施していく予定です。

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)

UCO: 格付基準変更に伴う見直し

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

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	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	○	AA-sf	弱含み	05/27/2022
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		PIFsf		03/25/2021
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	07/04/2022
Cafes I (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		PIFsf		10/21/2019
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		PIFsf		04/20/2021
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	○	AAAsf	安定的	03/28/2022
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	○	BBB-sf	安定的	03/28/2022
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		PIFsf		01/27/2020
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		PIFsf		07/25/2022
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		PIFsf		07/25/2022
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		PIFsf		07/25/2022
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)

UCO: 格付基準変更に伴う見直し

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史料する案件。

△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	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		PIFsf		08/25/2020
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		PIFsf		03/25/2022
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		PIFsf		03/25/2022
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	03/28/2022
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	03/28/2022
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		PIFsf		06/25/2020
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		PIFsf		09/27/2021
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		PIFsf		02/25/2021
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		PIFsf		08/27/2019
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)

UCO: 格付基準変更に伴う見直し

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) 格付日は、当該格付に関する格付アクションを公表した日(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	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	03/28/2022
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	03/28/2022
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		PIFsf		12/29/2021
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		PIFsf		12/27/2019
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

レバード・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	05/27/2022
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	05/27/2022
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	○	AAAsf	安定的	05/27/2022
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	○	AA+sf	安定的	05/27/2022
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	○	BBBsf	安定的	05/27/2022
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	○	BBB-sf	安定的	05/27/2022
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	04/27/2022
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	○	AAAsf	安定的	04/27/2022
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)

UCO: 格付基準変更に伴う見直し

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 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	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		PIFsf		03/25/2019
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		PIFsf		03/25/2019
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		PIFsf		03/25/2019
ハイドラ・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
ハイドラ・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		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	レポート 参照	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
ハイドラ・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
ハイドラ・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)

UCO: 格付基準変更に伴う見直し

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示。

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©2022年フィッチ・レーティングス・ジャパン・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、引受会社及びその他フィッチが信頼に足ると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、格付方法に則り依拠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依拠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、現時点の事実を検証するにもかかわらず、格付付与又は据置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。