

平成 24 年 1 月 26 日

各 位

三菱 UFJ モルガン・スタンレー証券株式会社

## オートローン債権証券化のアレンジメントに関するお知らせ

当社は、フォルクスワーゲン・ファイナンシャル・サービス・ジャパン株式会社(代表取締役社長 横瀬 正幸)が実施するオートローン債権証券化(以下、DRIVER JAPAN ONE)のアレンジ並びに当該案件の信託受益権の発行にかかる取得の申込み勧誘及び信託向けの責任財産限定特約付きローン(Asset Backed Loan 以下、ABL)の媒介を行いましたので、下記のとおりお知らせいたします。

記

### 1. 証券化による資金調達手段について

証券化は、お客さまの保有する資産を活用した資金調達手段であり、お客さまの信用力に依拠せず、資産の信用力に依拠した資金調達手段です。信用補完など、ストラクチャー面の工夫により高い格付を目指すことで、一般的に低利調達にもつながることから、お客さまの資金調達手段の一つとして非常に有益な調達手段といえます。

### 2. 本オートローン債権証券化の特徴について

DRIVER JAPAN ONE は、フォルクスワーゲン・グループがグローバルに展開する証券化プログラム(DRIVER シリーズ)のフレームワークに準拠した本邦初の証券化案件です。

本件は、国内における通常の均等返済型のオートローン債権に加えて、残価設定型のオートローン債権を証券化対象としております。当該残価設定型のオートローン債権を裏付けとする証券化で、且つ広く投資家(特定投資家限定)に販売する案件としても本邦初のものであり、証券化市場の更なる発展に資するパイオニア案件として意義深いものであると考えております。

尚、DRIVER JAPAN ONE の発行概要に関しては別紙をご参照ください。

今後も三菱 UFJ モルガン・スタンレー証券は、お客さまのあらゆるニーズに応えるべく、経営的、財務的な側面から革新的なソリューション提供に積極的に取り組んで参ります。

以上

(ご注意)

この文書は、いかなる証券についての投資募集行為の一部をなすものでもありません。この文書は、フォルクスワーゲン・ファイナンシャル・サービスジャパン株式会社がオリジネートするオートローン債権証券化(案件名:DRIVER JAPAN ONE)の実施に関して一般に公表することのみを目的とする文書であり、日本国内外を問わず投資勧誘等を目的として作成されたものではありません

(別紙)

DRIVER JAPAN ONE 発行概要

(1) 案件名	DRIVER JAPAN ONE
(2) 発行額	250 億円(信託受益権 189 億円、ABL61 億円)
(3) 裏付け債権	株式会社ジャックス保証付きオートローン債権 約 273 億円
(4) 裏付け債権件数	17,182 件
(5) 信託設定日	2012 年 1 月 13 日
(6) 払込日	2012 年 1 月 26 日
(7) リボルビング期間	2012 年 1 月から 1 年間
(8) 最終償還期日/ 最終返済期日	2020 年 5 月 28 日
(9) 劣後比率	約 8.5%
(10) 取得格付 <sup>注1</sup>	Aaa(sf): ムーディーズ SF ジャパン株式会社 AAA(sf): スタンダード&プアーズ・レーティング・ジャパン株式会社 AAA: 株式会社格付投資情報センター
(11) オリジネーター/ 第一信託委託者	フォルクスワーゲン・ファイナンシャル・サービス・ジャパン株式会社
(12) サービサー	フォルクスワーゲン・ファイナンシャル・サービス・ジャパン株式会社
(13) サブ・サービサー	株式会社ジャックス
(14) 受託者	新生信託銀行株式会社
(15) 第一信託への ABL レンダー/ 第二信託委託者	三菱 UFJ モルガン・スタンレー証券株式会社 ロイヤルバンク・オブ・スコットランド・ピーエルシー東京支店
(16) アレンジャー	三菱 UFJ モルガン・スタンレー証券株式会社 アール・ビー・エス証券会社東京支店

注 1: ムーディーズ SF ジャパン株式会社 : 金融庁長官(格付)第 3 号  
スタンダード&プアーズ・レーティング・ジャパン株式会社 : 金融庁長官(格付)第 5 号  
株式会社格付投資情報センター : 金融庁長官(格付)第 6 号

(ご注意)

この文書は、いかなる証券についての投資募集行為の一部をなすものでもありません。この文書は、フォルクスワーゲン・ファイナンシャル・サービスジャパン株式会社がオリジネートするオートローン債権証券化(案件名:DRIVER JAPAN ONE)の実施に関して一般に公表することのみを目的とする文書であり、日本国内外を問わず投資勧誘等を目的として作成されたものではありません