Contract No: 040821025110

信託財産状況報告書　Trust Assets Status Report Summary
Silver Arrow Japan 202502_2

当該信託計算期間に係る各期日	Key Dates for this Trust Calculation Period			
信託設定日	Trust Commencement Date	2025/11/26		
信託計算期間	Trust Calculation Period	2026/9/25	～	2026/10/26
利息計算期間	Interest Calculation Period	2026/9/28	～	2026/10/28
信託計算期日	Trust Calculation Date	2026/10/26		
第二信託交付日	Second Trust Payment Date	2026/10/28		

信託財産状況報告書　Trust Assets Status Report Summary
Silver Arrow Japan 202502_2

信託計算期日(Trust Calculation Date):2026/10/26
第二信託交付日(Second Trust Payment Date):2026/10/28

【1】勘定残高 (Ending Balance)　　単位:円 (All Values in JPY)

収益回収金勘定 (Profit Ledger)

期初残高	Beginning Balance	5,559
増加	Increase	53,333,333
減少	Decrease	53,333,329
期末残高	Ending Balance	5,563

元本回収金勘定 (Principal Ledger)

期初残高	Beginning Balance	0
増加	Increase	0
減少	Decrease	0
期末残高	Ending Balance	0

合計 (Total)

期初残高	Beginning Balance	5,559
増加	Increase	53,333,333
減少	Decrease	53,333,329
期末残高	Ending Balance	5,563

【2】受益権残高 (Breakdown For Asset Backed Loan and Beneficial Interest)　　単位:円 (All Values in JPY)

信託受益権 (Beneficial Interest)

期初残高	Beginning Balance	16,400,000,000
増加	Increase	0
減少	Decrease	0
期末残高	Ending Balance	16,400,000,000
収益配当額・予定利息額	Dividend・Interest	17,493,333

第二信託ABL (Asset Backed Loan to Second Trust)

期初残高	Beginning Balance	33,600,000,000
増加	Increase	0
減少	Decrease	0
期末残高	Ending Balance	33,600,000,000
収益配当額・予定利息額	Dividend・Interest	35,839,996

合計 (Total)

期初残高	Beginning Balance	50,000,000,000
増加	Increase	0
減少	Decrease	0
期末残高	Ending Balance	50,000,000,000
収益配当額・予定利息額	Dividend・Interest	53,333,329

【3】貸借対照表 (Balance Sheet)　　(現在 (as of) 2026/10/28)

単位:円 (All Values in JPY)

資産の部(Assets)		負債の部(Liabilities)	
科目(Items)	金額(Amount)	科目(Items)	金額(Amount)
金銭債権(Receivables)	50,000,000,000	信託元本(Trust Principal)	16,400,000,000
信託債権(Trusted Assets)	50,000,000,000	信託受益権(Beneficial Interest)	16,400,000,000
普通預け金(Deposits)	5,563		
収益回収金勘定(Profit Ledger)	5,563		
元本回収金勘定(Principal Ledger)	0	借入金(Loan)	33,600,000,000
		仮受金(Suspense receipt)	5,563
合計(Total)	50,000,005,563	合計(Total)	50,000,005,563

【4】損益計算書(Profit and Loss Statement)　　(自(from)2026/9/25)
(至(To)2026/10/26)

単位:円 (All Values in JPY)

科目(Item)	金額(Amount)
収益の部(Profits)	
信託債権収益(Interest on the Asset Backed Loans to the First Trust)	53,333,333
その他収益(運用益含む)(Other profits from Investment earnings)	0
合計(Total)	53,333,333
費用の部(Expense)	
公租公課(Taxes and Public Charges)	0
信託報酬(Fees for the Trustee)	0
信託財産負担費用(Trust Expenses)	0
第二信託受益権配当(Dividend of the Beneficial Interest)	17,493,333
第二信託ABL利息(Interest on the Asset backed Loan to the Second Trust)	35,839,996
合計(Total)	53,333,329
当期損益(Profit and Loss)	4

【5】信託債権元本の状況(Entrusted Asset Information)

単位:円 (All Values in JPY)

債権の種類(Type)	貸付債権(Loan receivables)
当期末残高(Amount)	50,000,000,000
当計算期間中における売買総額(Transaction(Purchase/Sell) during corresponding calculation period)	0

【6】その他信託財産の状況(Other Entrusted Asset Information)

単位:円 (All Values in JPY)

対象財産の種類(Type)	金銭(Cash)
当期末残高(Amount)	5,563

信託財産借入の状況(Obligations)

返済方法(Repayment)	パススルー(Pass-Through)
担保の設定(Collateral)	なし(Nil)
借入の目的及び使途(Purpose and use)	優先受益権の償還(Redeem the Senior Beneficial Interest)
総借入金額(Amount)	33,600,000,000円

当初借入日 Date of Loan	返済期限 Maturity	借入先属性 Lender Attributes	当初借入金額 Initial Loan Amount	当期末残高 Ending Balance	利率 Applicable Interest Rate	利息額 Interest
2025/11/26	2034/5/25	金融法人 Financial Institution	9,800,000,000円	9,800,000,000円	1.280%	10,453,333円
2025/11/26	2034/5/25	金融法人 Financial Institution	9,300,000,000円	9,300,000,000円	1.280%	9,920,000円
2025/11/26	2034/5/25	金融法人 Financial Institution	4,000,000,000円	4,000,000,000円	1.280%	4,266,666円
2025/11/26	2034/5/25	金融法人 Financial Institution	2,800,000,000円	2,800,000,000円	1.280%	2,986,666円
2025/11/26	2034/5/25	金融法人 Financial Institution	1,800,000,000円	1,800,000,000円	1.280%	1,920,000円
2025/11/26	2034/5/25	金融法人 Financial Institution	1,500,000,000円	1,500,000,000円	1.280%	1,600,000円
2025/11/26	2034/5/25	金融法人 Financial Institution	1,300,000,000円	1,300,000,000円	1.280%	1,386,666円
2025/11/26	2034/5/25	金融法人 Financial Institution	1,100,000,000円	1,100,000,000円	1.280%	1,173,333円
2025/11/26	2034/5/25	金融法人 Financial Institution	1,000,000,000円	1,000,000,000円	1.280%	1,066,666円
2025/11/26	2034/5/25	金融法人 Financial Institution	1,000,000,000円	1,000,000,000円	1.280%	1,066,666円

・本信託財産状況報告書を以って，信託業法第27条第1項に定める信託財産状況報告書とします。
This Trust Assets Status Report Summary shall serve as ″Trust Assets Status Report ″ as defined in Article 27, Paragraph 1, of ″the Trust Business Act″.

以上(End)