



News Release

06-D-020

2006年4月3日

バーゼルⅡにおける適格格付機関の認定について

金融庁は2006年3月31日、バーゼルⅡにおいて利用可能な格付機関(適格格付機関)を定めるとともに、各適格格付機関について、バーゼルⅡの予備計算期間(06年3月末開始)に適用される格付けと「信用リスク区分」及び「リスク・ウェイト」との対応関係(マッピング)を発表した。

この中で、日本格付研究所(JCR)は適格格付機関として認定され、その格付けがバーゼルⅡのもとで銀行監督に活用されることとなった。また、マッピングについては、一部のエクスポージャーの低位格付け記号についてバーゼルⅡの基準より高いリスク・ウェイトが適用されることを除き、JCRの格付けのリスク・ウェイトはバーゼルⅡの基準と同一とされた。このことは、JCRの格付けが金融機関等のリスク管理に有意義な情報を提供していることを反映したものと、JCRでは考えている。JCRでは、今回の適格格付機関認定およびマッピングの決定をうけて、これまでの格付けの枠組み・基準等を引き続き維持し、今後とも、格付けの中立・公正性等に留意しつつ、その格付けが投資家のリスク管理や銀行監督にとってより有用な役割を果たせるよう努めていきたいと考えている。

以上

格付けは、信用すべき情報に基づいたJCRの意見の表明であり、その正確性、完全性、特定の目的への適合性等は一切保証されておりません。
また、格付けは、信用リスクの判断や個別の施策、コマーシャルペーパー等の発行・保有を判断するものではありません。
格付けは原則として発行者から対価を受領して行っております。

※無断コピー・転送は固くお断りします。

株式会社 日本格付研究所

〒104-0061 東京都中央区銀座5-15-8 時事通信ビル

＜情報提供電子メディア(検索コード)＞

BLOOMBERG(和文:JCRA/英文:JCR) REUTERS(EJCRA)
QUICK(和文:QR/英文:QQ) TELERATE JUI PRESS

＜お問い合わせ先＞

TEL:03-3544-7013 FAX:03-3544-7026 担当:情報・研修部
<http://www.jcr.co.jp>