



News Release

06-D-1242
2007年3月30日

バーゼルⅡの実施にあたって

2007年3月31日から、銀行等の新しい自己資本規制(バーゼルⅡ)が実施される。日本格付研究所(JCR)は適格格付機関として、その格付けが銀行等の自己資本比率計算に非常に重要な意味をもつことを踏まえ、以下の媒体での格付一覧公開などを通じ、格付情報を適時・適切に銀行等・発行体・投資家へ提供していく。

- ・ ホームページ(<http://www.jcr.co.jp/>) (一覧は長期優先債務格付けなど主要な格付け)
- ・ 会員向けウェブサイト「JCR-RatingEye」
- ・ データベース・サービス「J-CRIS」(Japan Credit Rating Information Service)
- ・ 月刊『JCR 格付け』

バーゼルⅡでは基本的に非依頼格付を利用できないが、JCR の場合、非依頼格付けには依頼格付けと区別するため格付記号の後に「p」を表示している。

格付けとバーゼルⅡでの「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)については、本日付の金融庁告示第28号により示された。06年のバーゼルⅡの予備計算期間開始にあたり示されていたマッピング案では、法人等向けエクスポージャーについてJCRの「BB-」のリスク・ウェイトがバーゼルⅡの基準値より高かったが、上記告示ではこのような取扱いはなされず、すべてのJCRの格付けのリスク・ウェイトがバーゼルⅡの基準値と同一となっている。

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債券、コマーシャルペーパー等の売買・保有を推奨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) JIJI PRESS 共同通信JLS

<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>