

2009年3月31日

「JCR 格付推移マトリックスおよび累積デフォルト率」の計算に使用したヒストリカル・データ(先数・件数ベース)

「JCR 格付推移マトリックスおよび累積デフォルト率」(2009年1月26日付プレスリリース 08-D-1071 で公表、弊社月報『JCR 格付け』2009年2月号(No.216)掲載、同年3月31日付プレスリリース 08-D-1426 で一部修正)に掲載された表1~3、表6~11の計算に使用したヒストリカル・データを、以下のフォルダおよびファイルに格納している。

[構成]

「1年後推移」フォルダ

「1998年01年後推移.xls」・・・「2007年01年後推移.xls」

- ・「表1 格付推移マトリックス(集計単位1年間)」の計算データ

「3年後推移」フォルダ

「1998年03年後推移.xls」・・・「2005年03年後推移.xls」

- ・「表2 格付推移マトリックス(集計単位3年間)」の計算データ

「5年後推移」フォルダ

「1998年05年後推移.xls」・・・「2003年05年後推移.xls」

- ・「表3 格付推移マトリックス(集計単位5年間)」の計算データ

「広義デフォルトに基づく格付カテゴリー別3年累積デフォルト率.xls」ファイル

- ・「表6 広義デフォルトに基づく格付カテゴリー別3年累積デフォルト率(過去10年の平均値)」の計算データ

「証券化商品」フォルダ

「証券化商品_経過別.xls」ファイル

- ・「表7 12ヶ月経過時点」の計算データ
- ・「表8 24ヶ月経過時点」の計算データ
- ・「表9 36ヶ月経過時点」の計算データ

「証券化商品_年度別.xls」ファイル

- ・「表10 06~08年の平均」の計算データ
- ・「表11 08年の平均」の計算データ