

2010 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」（2010 年 1 月 26 日日付プレスリリース 09-D-0973）で公表、弊社月報『JCR 格付』2010 年 2 月号（No.228）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

- 「1999 年 01 年後推移.xls」・・・「2008 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）の掲載データ

「3 年後推移」フォルダ

- 「1999 年 03 年後推移.xls」・・・「2006 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）の掲載データ

「5 年後推移」フォルダ

- 「1999 年 05 年後推移.xls」・・・「2004 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）の掲載データ

「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 07～08 年の平均」の計算データ
- ・「表 11 09 年の平均」の計算データ