

2011年2月18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」（2011年2月18日日付プレスリリース 10-D-0917）で公表された表 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

- 「2000年01年後推移.xls」・・・「2009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

- 「2000年03年後推移.xls」・・・「2007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

- 「2000年05年後推移.xls」・・・「2005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 08~10年の平均」の計算データ
- ・「表 11 10年の平均」の計算データ