

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