

2012年2月28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」（2012年2月28日日付プレスリリース11-D-0928）で公表された表1～3、表5～14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

「2001年01年後推移.xls」・・・「2010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
- ・「表5 格付カテゴリー別累積デフォルト率」の掲載データ

「3年後推移」フォルダ

「2001年03年後推移.xls」・・・「2008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
- ・「表5 格付カテゴリー別累積デフォルト率」の掲載データ

「5年後推移」フォルダ

「2001年05年後推移.xls」・・・「2006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
- ・「表5 格付カテゴリー別累積デフォルト率」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 09～11年の平均」の計算データ
- ・「表11 11年の平均」の計算データ

「その他」フォルダ

「その他.xls」ファイル

- ・「表12 その他のストラクチャード・ファイナンス商品及び投資法人(J-REIT)」
- ・「表13 その他のストラクチャード・ファイナンス商品」
- ・「表14 投資法人(J-REIT)」