

金融機関格付推移

金融機関(保険会社を除く)長期発行体デフォルト格付

IDR (%)	2012/01/01-2012/12/31							
	AAA	AA	A	BBB	BB	B	CCC	CC 以下
AAA	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%
AA	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%
A	0.0%	0.0%	92.0%	8.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%
BBB	0.0%	0.0%	0.0%	100.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%
BB	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%
B	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%
CCC	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%
CC 以下	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%

保険会社財務格付

IFS (%)	2012/01/01-2012/12/31							
	AAA	AA	A	BBB	BB	B	CCC	CC 以下
AAA	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%
AA	0.0%	100.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%
A	0.0%	0.0%	100.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%
BBB	0.0%	0.0%	0.0%	100.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%
BB	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	100.0%	0.0%	0.0%	0.0%
B	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%
CCC	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%
CC 以下	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%

コホート分析に基づく格付推移行列(格付カテゴリーベース)は、上表のとおりである。コホート分析は、年初における格付が年末にどのような格付に推移したかを示すものであるが、その集計手法の特性から、その間の格付推移や当初格付の年末迄の推移が反映されないなどの点に留意が必要である。