

2007年5月22日

## R & I、米 SEC の指定格付機関の認定取得 北米以外の格付会社では初めて

格付投資情報センター (R&I)は 2007 年 5 月 21 日、米証券取引委員会 (SEC) から NRSRO (Nationally Recognized Statistical Rating Organization、事実上の SEC 認定格付機関) の認定を取得しました。NRSRO に認定された格付会社としては 6 社目で、日本国内ではもちろん、北米 (米国、カナダ) 以外の格付会社では初めてです。R&I はこれまで長年にわたり SEC に対して NRSRO の認定を要請してきたことから、2006 年 9 月末に成立した米格付会社改革法の施行 (2007 年 6 月の予定) に先駆け認定されました。

NRSRO は、SEC が米国証券会社の自己資本比率を算定する際に、保有有価証券の信用度合いに関する情報を提供するなど、監督の補助手段としての役割を果たしています。また SEC のほか、多くの機関投資家、金融機関が投資対象債券を選定する際に、NRSRO の格付けを基準として利用しています。

今回の認定は、R&I が (1) 米国市場で広く認知された格付会社である (2) 独立して格付け業務を行うのに十分な財務基盤を有している (3) 信頼できる格付けを提供するための方法論と内部手続きを備えている (4) 非公開情報の管理体制が十分に整っている——などの点を SEC が確認した結果であり、今後の R&I の格付け方針等に何ら影響を与えるものではありません。

R&I が NRSRO に認定されたことにより、米国投資家に対し、本邦発行体の債券、サムライ債およびユーロ円債の信用リスク等に関して、広範囲かつ詳細な情報の提供が可能となるほか、日本企業が米国で業務提携契約などを締結する際、R&I の格付けを引用することにより、その信用状態をより簡便、的確に伝えることができるようになります。

R&I は海外の監督当局からは、NRSRO のほかに、2006 年 6 月、香港金融管理局から、香港の銀行に適用される新 BIS 規制の適格格付機関として認定されています。また、英国の証券先物管理局 (SFA) も、R&I を金融機関のための「適格債券」判定についての「参照格付機関」としています。

R&I は 1998 年、日本インベスターズサービス (NIS) と日本公社債研究所 (JBRI) が合併して発足しました。JBRI は 1977 年に日本で最初に試験的に格付けを公表しました。R&I は現在、日本で最も数多くの発行体に信用格付けを付与しています。また各種の金融情報サービスや無料ホームページなどを通じて、発行体、投資家をはじめとする市場関係者に広く情報を提供しています。R&I はニューヨークと香港に事務所を持ち、海外の国や企業にも格付けを付与しています。

SEC はこれまでに、スタンダード・アンド・プアーズ、ムーディーズ・インベスターズ・サービス、フィッチ・レーティングス、A.M.ベスト (以上米国) ドミニオン・ボンド・レーティング・サービス (カナダ) の 5 社を NRSRO に認定しています。

### (株) 格付投資情報センター (R&I) の概要

本社：東京

資本金：5 億 8800 万円

代表取締役社長：久保庭 啓一郎

社員数：166 人 (2007 年 4 月末)

主要株主：日本経済新聞社グループ (58.52%、2007 年 3 月末)

●お問い合わせ先 **格付投資情報センター 経営企画室** 〒103-0027 東京都中央区日本橋 1-4-1 日本橋一丁目ビルディング

TEL.03-3276-3497 FAX.03-3276-3405 <http://www.r-i.co.jp> E-mail: infodept@r-i.co.jp

格付けは、発行体が負う金融債務についての総合的な債務履行能力や個々の債務 (債券やローンなど) の支払いの確実性 (信用力) に対する R&I の意見を、一定の符号で投資家に投資情報として提供するものであり、債券や商業ペーパーなどの売買・保有を推奨するものではありません。格付けは信頼すべき情報に基づいた R&I の意見であり、その正確性及び完全性は必ずしも保証されてはいません。格付けは原則として発行者から対価を受領して実施したものです。