

PSJ 予測統計値
(平均値)

2006年 9月 1日 公表

貸付債権担保住宅金融公庫債券											
報告参加会員：新光,野村,三菱UFJ,ゴールドマン・サックス,モルガン・スタンレー,クレディ・スイス,ドイツ・リマン・ブザーク,JPモルガン,みずほ,UBS,メルリッチ日本,大和SMB,日興証券グループ											
回号	Yield Curve Scenarios (%)									最低 / 最高 (%)	
	-300bp	-200bp	-100bp	-50bp	0bp	50bp	100bp	200bp	300bp		
1	13.36	12.64	9.59	8.18	7.44	6.99	6.68	6.29	5.99	5.70 /	9.08
2	13.32	12.56	9.51	8.13	7.42	6.97	6.66	6.28	5.99	5.71 /	9.03
3	13.43	12.67	9.58	8.17	7.45	6.98	6.68	6.29	6.01	5.85 /	9.07
4	12.80	12.03	9.02	7.86	7.27	6.89	6.62	6.27	5.97	5.80 /	8.71
5	12.67	11.90	8.94	7.79	7.24	6.88	6.62	6.25	5.96	5.88 /	8.57
6	12.73	11.95	8.95	7.81	7.28	6.90	6.65	6.28	5.98	5.97 /	8.60
7	12.76	11.96	8.93	7.83	7.31	6.95	6.68	6.31	6.02	5.99 /	9.32
8	12.75	11.94	8.90	7.81	7.30	6.93	6.66	6.31	6.00	6.07 /	8.96
9	12.35	11.51	8.69	7.69	7.19	6.84	6.59	6.24	5.95	5.99 /	8.46
10	12.27	11.42	8.63	7.69	7.23	6.89	6.65	6.31	6.01	6.06 /	8.66
11	12.16	11.27	8.48	7.61	7.16	6.83	6.60	6.25	5.97	6.01 /	8.33
12	12.24	11.36	8.43	7.62	7.23	6.90	6.68	6.34	6.03	5.85 /	9.14
13	12.27	11.39	8.51	7.67	7.23	6.90	6.66	6.32	6.03	5.96 /	9.41
14	12.32	11.44	8.52	7.64	7.20	6.86	6.63	6.27	5.98	6.00 /	8.81
15	12.30	11.41	8.49	7.64	7.21	6.88	6.63	6.30	6.01	6.01 /	8.96
16	12.28	11.38	8.48	7.65	7.21	6.89	6.65	6.30	6.02	5.97 /	9.19
17	12.22	11.33	8.45	7.61	7.19	6.87	6.64	6.28	6.01	5.97 /	8.97
18	12.20	11.28	8.43	7.61	7.19	6.87	6.64	6.30	6.00	6.00 /	9.09
19	12.18	11.26	8.41	7.60	7.18	6.87	6.64	6.29	6.01	6.00 /	9.09
20	12.50	11.56	8.55	7.66	7.23	6.92	6.68	6.34	6.04	5.97 /	8.79
21	12.53	11.57	8.53	7.69	7.28	6.98	6.73	6.38	6.09	5.99 /	9.25
22	12.65	11.70	8.57	7.71	7.29	6.95	6.71	6.36	6.07	6.10 /	8.90
23	12.98	12.04	8.75	7.81	7.35	7.02	6.78	6.40	6.11	6.16 /	9.34
24	12.95	11.98	8.81	7.83	7.35	7.02	6.76	6.40	6.11	6.14 /	8.85
25	12.74	11.77	8.60	7.72	7.30	6.98	6.74	6.40	6.09	6.09 /	8.63
26	12.34	11.34	8.41	7.66	7.22	6.93	6.70	6.36	6.05	5.79 /	9.00
27	12.14	11.14	8.30	7.56	7.22	6.93	6.71	6.38	6.08	5.89 /	8.60
28	12.48	11.44	8.41	7.61	7.23	6.92	6.69	6.36	6.07	5.92 /	8.62
29	12.07	11.03	8.27	7.56	7.23	6.94	6.73	6.40	6.10	5.84 /	9.08
30	12.04	10.95	8.28	7.61	7.29	7.00	6.78	6.45	6.16	5.85 /	9.85
31	11.83	10.74	8.16	7.56	7.19	6.92	6.71	6.38	6.09	5.75 /	9.19
32	11.55	10.43	8.01	7.47	7.13	6.87	6.66	6.35	6.06	5.62 /	8.53
33	11.96	10.85	8.18	7.57	7.20	6.93	6.71	6.39	6.08	5.80 /	8.82
34	11.75	10.59	8.09	7.49	7.15	6.89	6.68	6.36	6.06	5.60 /	8.68
35	11.88	10.69	8.10	7.50	7.14	6.89	6.67	6.35	6.06	5.65 /	8.58
36	12.17	11.04	8.22	7.55	7.23	6.94	6.72	6.39	6.09	5.86 /	9.02
37	12.17	11.02	8.26	7.61	7.20	6.93	6.71	6.39	6.09	5.78 /	8.89
38	12.48	11.35	8.38	7.61	7.24	6.95	6.71	6.37	6.07	5.95 /	8.58
39	12.45	11.25	8.33	7.60	7.27	6.98	6.76	6.42	6.12	5.87 /	9.29
40	13.03	11.87	8.62	7.75	7.34	7.02	6.78	6.44	6.14	6.18 /	9.17
41	12.72	11.50	8.46	7.68	7.31	7.02	6.78	6.44	6.14	5.93 /	9.36
42	13.28	12.05	8.83	7.93	7.42	7.10	6.86	6.50	6.20	6.17 /	9.89
43	13.64	12.42	8.97	7.96	7.41	7.07	6.82	6.46	6.14	6.43 /	9.02
44	14.33	13.13	9.34	8.16	7.56	7.17	6.89	6.51	6.20	6.77 /	9.35
45	14.20	12.92	9.22	8.13	7.55	7.19	6.90	6.54	6.24	6.64 /	9.54
46	14.36	13.08	9.23	8.11	7.54	7.17	6.92	6.53	6.24	6.67 /	9.48
S1	13.36	12.54	9.63	8.26	7.52	7.08	6.77	6.37	6.09	5.74 /	9.14
S2	13.34	12.52	9.60	8.21	7.44	6.98	6.69	6.28	6.00	5.79 /	8.96
S3	13.28	12.48	9.52	8.14	7.42	6.96	6.65	6.27	5.98	5.80 /	8.98
S4	13.17	12.34	9.36	8.05	7.38	6.95	6.65	6.27	5.98	5.80 /	8.99
S5	13.10	12.29	9.29	8.01	7.35	6.92	6.62	6.26	5.97	5.79 /	9.01

貸付債権担保住宅金融公庫債券

報告参加会員：新光、野村、三菱UFJ、ゴールドマン・サックス、モルガン・スタンレー、クレディ・スイス、ドイツ・リマン・ブラザーズ、JPモルガン、みずほ、UBS、メリル・リンチ日本、大和SMBC、日興シティグループ

回号	Yield Curve Scenarios (%)									最低 / 最高 (%)
	-300bp	-200bp	-100bp	-50bp	0bp	50bp	100bp	200bp	300bp	
S6	12.99	12.19	9.31	8.04	7.34	6.93	6.64	6.29	6.00	5.86 / 8.92
S7	12.99	12.20	9.33	8.04	7.36	6.94	6.65	6.29	6.00	5.84 / 8.92

1. 本資料に記載するPSJ予測統計値は、一定の要件を満たす証券会社から発表日（毎月1日及び15日、休業日の場合は翌営業日。以下 同じ。）の前営業日の午後3時現在における予測期限前償還率をPSJモデルに換算した値（以下「PSJ予測値」。）について本協会が報告を受け、集計のうえ統計処理を行った数値です。
2. 本資料は、発表日の前営業日の午後3時現在におけるMBSのPSJ予測統計値の情報提供を唯一の目的としており、本資料に記載された金融商品への投資を推奨・勧誘するものではありません。最終的な投資判断は御自身でお願いいたします。
3. 本資料に記載するPSJ予測統計値は、発表日の前営業日の午後3時現在における経済・金融情勢や公表済みデータ等に基づくPSJ予測値により算出したものです。したがって、証券会社におけるPSJ予測値算出時以降に、前提条件等が変化した場合には、当然にPSJ予測統計値が異なる可能性があります。
4. 本資料に記載するPSJ予測統計値の算出に当たっては、一定の要件を満たす証券会社からPSJ予測値の報告を受けておりますが、当該証券会社は、本協会に対してPSJ予測値の正確性及び完全性を保証するものではありません。また、PSJ予測統計値について、本協会として、その正確性及び完全性に関して責任を負うものではありません。
5. 本協会は、個々の証券会社が算出するPSJ予測値についての御照会には応じかねますので、あらかじめ御了解ください。本協会は、本資料の欠落・誤謬等についてその責を負いかねますので御了承ください。