

PSJ 予測統計値
(平均値)

2006年 8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・ブラザーズ,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	13.41	12.42	8.85	7.81	7.27	6.88	6.61	6.24	5.98	5.19 /	8.62
2	13.37	12.36	8.79	7.78	7.26	6.86	6.60	6.25	5.98	5.23 /	8.59
3	13.49	12.43	8.84	7.82	7.28	6.89	6.63	6.27	6.01	5.38 /	8.62
4	12.85	11.74	8.45	7.65	7.15	6.81	6.58	6.25	5.98	5.40 /	8.40
5	12.73	11.58	8.39	7.60	7.13	6.81	6.58	6.25	5.99	5.51 /	8.26
6	12.79	11.65	8.42	7.64	7.17	6.84	6.61	6.29	6.03	5.57 /	8.25
7	12.82	11.64	8.42	7.67	7.21	6.88	6.66	6.34	6.09	5.73 /	9.02
8	12.82	11.62	8.40	7.66	7.19	6.86	6.64	6.32	6.08	5.72 /	8.69
9	12.43	11.19	8.24	7.57	7.11	6.80	6.58	6.28	6.05	5.63 /	8.13
10	12.34	11.09	8.24	7.59	7.15	6.85	6.64	6.34	6.11	5.78 /	8.42
11	12.24	10.89	8.12	7.52	7.09	6.79	6.59	6.30	6.07	5.72 /	8.13
12	12.31	10.92	8.10	7.56	7.16	6.87	6.67	6.39	6.16	5.86 /	8.92
13	12.10	10.95	8.17	7.58	7.17	6.87	6.67	6.38	6.16	5.73 /	9.18
14	12.36	11.05	8.15	7.55	7.13	6.83	6.62	6.33	6.10	5.81 /	8.58
15	12.35	11.00	8.14	7.56	7.13	6.83	6.63	6.34	6.12	5.84 /	8.69
16	12.33	10.96	8.15	7.57	7.15	6.86	6.65	6.37	6.15	5.84 /	8.96
17	12.27	10.90	8.11	7.54	7.12	6.83	6.63	6.34	6.13	5.79 /	8.75
18	12.25	10.84	8.09	7.53	7.12	6.84	6.64	6.35	6.13	5.74 /	8.86
19	12.22	10.82	8.09	7.53	7.12	6.84	6.63	6.35	6.13	5.73 /	8.87
20	12.56	11.13	8.18	7.60	7.20	6.91	6.70	6.41	6.19	5.96 /	8.58
21	12.59	11.12	8.19	7.65	7.24	6.96	6.75	6.45	6.23	6.12 /	8.99
22	12.71	11.27	8.23	7.66	7.25	6.95	6.74	6.44	6.22	6.11 /	8.67
23	13.04	11.56	8.36	7.67	7.32	7.02	6.80	6.49	6.27	6.11 /	9.02
24	13.02	11.55	8.43	7.68	7.31	7.02	6.80	6.50	6.27	6.11 /	8.61
25	12.82	11.33	8.28	7.69	7.30	7.00	6.79	6.49	6.27	6.13 /	8.41
26	12.41	10.85	8.12	7.58	7.21	6.94	6.74	6.45	6.24	6.09 /	8.81
27	12.19	10.67	8.04	7.57	7.22	6.95	6.76	6.48	6.27	6.14 /	8.39
28	12.54	10.96	8.14	7.60	7.24	6.96	6.76	6.47	6.26	6.12 /	8.43
29	12.14	10.55	8.06	7.60	7.25	6.99	6.81	6.52	6.32	6.21 /	8.93
30	12.10	10.45	8.10	7.67	7.33	7.07	6.88	6.60	6.39	6.24 /	9.70
31	11.88	10.25	7.97	7.56	7.23	6.98	6.79	6.52	6.31	6.19 /	9.05
32	11.60	9.96	7.87	7.49	7.17	6.94	6.76	6.51	6.30	6.16 /	8.41
33	12.00	10.34	7.99	7.57	7.23	6.98	6.80	6.53	6.32	6.22 /	8.63
34	11.80	10.07	7.91	7.50	7.19	6.95	6.77	6.51	6.30	6.18 /	8.56
35	11.92	10.18	7.93	7.52	7.20	6.96	6.78	6.52	6.31	6.21 /	8.45
36	12.23	10.55	8.05	7.62	7.27	7.02	6.83	6.55	6.34	6.27 /	8.86
37	12.23	10.50	8.07	7.59	7.26	7.01	6.82	6.55	6.34	6.26 /	8.74
38	12.57	10.89	8.17	7.65	7.30	7.04	6.84	6.57	6.35	6.30 /	8.67
39	12.50	10.68	8.13	7.65	7.32	7.06	6.87	6.61	6.39	6.30 /	9.10
40	13.08	11.34	8.35	7.71	7.41	7.13	6.92	6.62	6.41	6.37 /	9.13
41	12.75	10.91	8.24	7.73	7.38	7.13	6.93	6.65	6.44	6.32 /	9.12
42	13.32	11.46	8.57	7.85	7.52	7.23	7.02	6.72	6.50	6.41 /	9.59
43	13.71	11.92	8.66	7.89	7.52	7.22	6.99	6.72	6.47	6.46 /	9.73
44	14.42	12.65	8.95	8.10	7.68	7.35	7.11	6.78	6.56	6.57 /	10.37
45	14.28	12.41	8.86	8.06	7.66	7.34	7.11	6.78	6.57	6.48 /	10.17
S1	13.37	12.26	8.85	7.80	7.25	6.87	6.58	6.20	5.95	5.31 /	8.56
S2	13.39	12.27	8.87	7.80	7.26	6.88	6.60	6.22	5.96	5.32 /	8.44
S3	13.33	12.23	8.78	7.75	7.23	6.84	6.56	6.19	5.94	5.33 /	8.45
S4	13.20	12.07	8.69	7.70	7.21	6.83	6.57	6.21	5.96	5.34 /	8.52
S5	13.14	12.01	8.63	7.67	7.19	6.82	6.56	6.21	5.96	5.41 /	8.50
S6	12.99	11.88	8.65	7.66	7.18	6.83	6.59	6.28	6.02	5.44 /	8.43

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、メリリヤ日本、大和SMBC、日興シイグループ

回号	Yield Curve Scenarios (%)									最低 / 最高 (%)
	-300bp	-200bp	-100bp	-50bp	0bp	50bp	100bp	200bp	300bp	
S7	13.01	11.89	8.67	7.67	7.18	6.83	6.58	6.26	6.00	5.41 / 8.45

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。