

PSJ 予測統計値
(中央値)

2006年 11月 15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,メルガン・スチール,クレディ・スイス,ドイツ・リマン・ブザーク,BNPパリバ,JPモルガン,みずほ,UBS,メリル・リンチ日本,大和SMBC,日興フィグループ										
回号	Yield Curve Scenarios (%)									最低 / 最高 (%)
	-300bp	-200bp	-100bp	-50bp	0bp	50bp	100bp	200bp	300bp	
1	12.04	12.04	8.45	7.87	7.34	7.18	6.92	6.60	6.06	5.73 / 9.13
2	12.11	12.11	8.82	7.83	7.43	7.13	6.92	6.53	5.98	5.76 / 9.02
3	12.29	12.29	8.37	7.88	7.54	7.10	6.89	6.67	6.12	5.85 / 9.14
4	11.53	11.47	8.21	7.71	7.39	7.09	6.79	6.55	6.02	5.92 / 8.72
5	11.29	11.29	8.64	7.83	7.29	7.05	6.78	6.42	5.82	6.02 / 8.41
6	11.50	11.50	8.41	7.91	7.33	6.99	6.80	6.55	5.84	6.09 / 8.45
7	11.83	11.83	8.43	7.98	7.29	7.02	6.88	6.61	5.98	6.19 / 9.29
8	11.61	11.56	8.33	7.79	7.29	7.06	6.84	6.62	5.97	6.22 / 8.98
9	11.63	11.56	8.34	8.05	7.24	7.04	6.86	6.51	5.82	6.14 / 8.31
10	11.56	11.49	8.34	7.88	7.21	6.99	6.87	6.64	5.90	6.16 / 8.55
11	11.39	11.23	8.32	7.98	7.20	6.90	6.90	6.64	5.89	5.88 / 8.20
12	11.13	10.84	8.13	7.82	7.25	7.07	6.95	6.66	5.92	6.32 / 9.05
13	11.26	11.07	8.18	7.96	7.48	7.03	6.96	6.58	5.92	5.85 / 9.27
14	11.32	11.12	8.35	7.91	7.17	6.93	6.88	6.57	5.93	6.04 / 8.67
15	11.32	11.04	8.24	7.91	7.17	6.94	6.90	6.60	5.94	5.97 / 8.82
16	11.21	10.96	8.18	7.88	7.27	7.02	6.94	6.59	5.93	5.97 / 9.10
17	11.26	10.98	8.18	7.83	7.22	7.01	6.94	6.61	5.96	5.91 / 8.90
18	11.22	10.92	8.14	7.82	7.33	7.02	6.94	6.60	5.96	5.85 / 8.95
19	11.16	10.82	8.24	7.72	7.30	7.07	6.92	6.64	5.98	5.84 / 8.95
20	11.85	11.27	8.45	7.67	7.26	7.03	6.87	6.69	6.00	6.44 / 8.65
21	11.79	11.17	8.50	7.56	7.36	7.07	6.91	6.74	6.05	6.59 / 9.11
22	12.12	11.29	8.54	7.67	7.24	7.02	6.87	6.79	6.04	6.61 / 8.80
23	12.15	11.32	8.59	7.74	7.26	7.01	6.88	6.78	6.07	6.63 / 8.79
24	11.94	11.20	8.56	7.69	7.43	7.00	6.85	6.76	6.08	6.61 / 8.69
25	11.44	10.83	8.46	7.65	7.28	6.96	6.80	6.69	6.11	6.63 / 8.47
26	11.22	10.60	8.23	7.53	7.13	6.98	6.86	6.72	6.07	6.60 / 8.86
27	10.06	9.82	7.94	7.48	7.30	6.93	6.80	6.69	6.15	6.44 / 8.53
28	10.83	10.24	8.21	7.65	7.28	6.89	6.75	6.67	6.11	6.52 / 8.52
29	9.97	9.76	7.95	7.69	7.29	6.90	6.76	6.66	6.17	6.39 / 9.06
30	9.92	9.76	8.00	7.75	7.30	6.86	6.74	6.48	6.16	6.37 / 9.77
31	9.72	9.57	7.94	7.71	7.17	6.81	6.73	6.65	6.16	6.32 / 9.12
32	9.59	9.44	7.84	7.52	7.07	6.81	6.74	6.64	6.18	6.28 / 8.63
33	9.89	9.72	7.97	7.35	7.08	6.84	6.74	6.65	6.18	6.35 / 8.74
34	9.61	9.48	7.79	7.55	7.03	6.90	6.73	6.61	6.19	6.28 / 8.68
35	9.70	9.53	7.83	7.63	7.05	6.79	6.69	6.63	6.19	6.31 / 8.68
36	10.11	9.86	7.95	7.69	7.16	6.85	6.72	6.62	6.17	6.37 / 8.94
37	9.98	9.76	7.92	7.48	7.02	6.85	6.72	6.62	6.18	6.36 / 8.80
38	10.37	10.10	8.00	7.67	7.35	6.91	6.69	6.63	6.19	6.42 / 8.69
39	10.21	9.94	7.96	7.47	7.22	6.92	6.71	6.63	6.20	6.40 / 9.17
40	10.85	10.48	8.21	7.70	7.45	7.00	6.72	6.63	6.18	6.49 / 9.03
41	10.32	10.06	7.99	7.55	7.27	6.86	6.57	6.45	6.20	6.42 / 9.24
42	10.87	10.52	8.02	7.67	7.37	6.97	6.83	6.62	6.20	6.49 / 9.72
43	11.58	10.98	8.13	7.70	7.54	7.09	6.73	6.64	6.21	6.57 / 8.81
44	12.86	11.94	8.39	7.78	7.61	7.28	6.76	6.59	6.20	6.71 / 9.11
45	12.35	11.51	8.58	7.75	7.55	7.17	6.74	6.64	6.20	6.65 / 9.33
46	12.60	11.70	8.59	7.74	7.56	7.22	6.76	6.65	6.22	6.70 / 9.22
47	12.67	11.74	8.57	7.73	7.55	7.20	6.77	6.58	6.22	6.72 / 8.97
48	11.44	10.73	8.25	7.65	7.45	6.99	6.76	6.65	6.22	6.56 / 9.15
S1	12.65	12.07	9.72	8.09	7.45	7.23	6.95	6.65	6.15	5.78 / 9.14
S2	12.82	12.03	9.67	8.12	7.44	7.27	6.92	6.61	6.15	5.87 / 9.02
S3	12.37	12.25	9.03	8.12	7.44	7.28	6.93	6.53	6.15	5.84 / 8.98

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・ブザース、BNPパリバ、JPモルガン、みずほ、UBS、メリル・リンチ日本、大和SMBC、日興フィグループ

回号	Yield Curve Scenarios (%)									最低 / 最高 (%)
	-300bp	-200bp	-100bp	-50bp	0bp	50bp	100bp	200bp	300bp	
S4	12.14	12.00	8.92	8.07	7.57	7.44	6.88	6.69	6.14	5.85 / 8.98
S5	12.49	12.44	8.58	7.80	7.57	7.16	7.03	6.72	6.15	5.86 / 9.00
S6	11.74	11.53	9.26	7.85	7.55	7.15	6.76	6.63	6.10	5.96 / 8.98
S7	11.70	11.52	9.25	7.87	7.58	7.52	6.76	6.64	6.10	5.94 / 8.99
S8	11.71	11.50	9.23	7.85	7.57	7.52	6.76	6.63	6.19	5.95 / 9.28
S9	11.72	11.31	9.08	7.72	7.53	7.52	6.78	6.64	6.09	5.77 / 8.95

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。