

PSJ 予測統計値  
(平均値)

2006年 9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,メルカント・スタンレー,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	14.22	12.93	9.63	8.27	7.46	7.03	6.70	6.34	6.07	5.66 /	9.09
2	14.17	12.85	9.60	8.21	7.43	7.03	6.69	6.31	6.05	5.68 /	9.04
3	14.26	12.99	9.64	8.25	7.46	7.04	6.70	6.34	6.08	5.83 /	9.10
4	13.49	12.21	9.05	7.95	7.32	6.94	6.67	6.32	6.03	5.79 /	8.74
5	13.27	12.02	8.94	7.83	7.27	6.89	6.66	6.29	6.00	5.88 /	8.55
6	13.38	12.10	8.98	7.88	7.34	6.92	6.68	6.32	6.04	5.95 /	8.58
7	13.48	12.16	9.01	7.92	7.36	7.00	6.72	6.39	6.11	6.04 /	9.35
8	13.41	12.12	8.96	7.88	7.34	6.97	6.70	6.36	6.09	6.07 /	8.99
9	13.02	11.70	8.75	7.78	7.23	6.86	6.64	6.27	6.03	5.98 /	8.44
10	12.96	11.62	8.72	7.79	7.27	6.95	6.69	6.36	6.09	6.06 /	8.67
11	12.82	11.46	8.56	7.71	7.20	6.88	6.64	6.29	6.05	5.96 /	8.34
12	12.88	11.53	8.52	7.72	7.29	6.94	6.75	6.41	6.12	6.14 /	9.15
13	12.99	11.63	8.62	7.79	7.31	6.96	6.75	6.39	6.15	5.93 /	9.42
14	12.97	11.62	8.61	7.73	7.26	6.92	6.66	6.32	6.08	6.10 /	8.82
15	12.95	11.59	8.58	7.74	7.28	6.94	6.67	6.37	6.08	6.06 /	8.97
16	12.96	11.56	8.57	7.75	7.29	6.96	6.70	6.36	6.11	6.06 /	9.20
17	12.86	11.50	8.55	7.70	7.27	6.93	6.69	6.34	6.09	6.00 /	8.98
18	12.88	11.47	8.52	7.72	7.27	6.94	6.70	6.39	6.11	5.93 /	9.10
19	12.84	11.44	8.53	7.71	7.26	6.93	6.70	6.36	6.11	5.93 /	9.10
20	13.08	11.68	8.61	7.73	7.27	6.96	6.71	6.39	6.13	6.22 /	8.81
21	13.16	11.73	8.61	7.77	7.35	7.05	6.78	6.44	6.17	6.35 /	9.26
22	13.24	11.82	8.64	7.79	7.34	6.99	6.74	6.43	6.15	6.38 /	8.91
23	13.55	12.15	8.80	7.87	7.41	7.05	6.81	6.46	6.20	6.38 /	9.36
24	13.47	12.07	8.86	7.90	7.39	7.06	6.80	6.47	6.17	6.39 /	8.86
25	13.25	11.84	8.65	7.77	7.34	7.01	6.80	6.43	6.17	6.39 /	8.65
26	12.87	11.42	8.46	7.68	7.28	6.99	6.75	6.40	6.14	6.32 /	9.02
27	12.65	11.23	8.35	7.62	7.27	6.99	6.75	6.44	6.18	6.40 /	8.65
28	12.97	11.49	8.46	7.69	7.28	6.97	6.72	6.40	6.14	6.37 /	8.65
29	12.64	11.13	8.33	7.66	7.31	7.02	6.79	6.47	6.21	6.38 /	9.14
30	12.71	11.14	8.39	7.75	7.41	7.12	6.90	6.55	6.31	6.38 /	9.92
31	12.38	10.86	8.23	7.59	7.27	7.00	6.78	6.48	6.19	6.27 /	9.26
32	12.01	10.49	8.07	7.49	7.19	6.93	6.73	6.42	6.14	6.10 /	8.60
33	12.44	10.91	8.23	7.57	7.24	6.98	6.78	6.45	6.19	6.33 /	8.88
34	12.17	10.61	8.13	7.51	7.18	6.95	6.74	6.41	6.14	6.07 /	8.75
35	12.26	10.72	8.15	7.52	7.19	6.91	6.73	6.41	6.13	6.15 /	8.65
36	12.66	11.11	8.27	7.65	7.30	6.99	6.79	6.45	6.21	6.39 /	9.09
37	12.62	11.06	8.31	7.61	7.26	6.98	6.75	6.46	6.18	6.31 /	8.94
38	12.94	11.41	8.41	7.67	7.31	7.00	6.75	6.42	6.15	6.44 /	8.63
39	12.94	11.34	8.38	7.68	7.34	7.04	6.83	6.49	6.24	6.42 /	9.35
40	13.57	11.96	8.66	7.83	7.41	7.08	6.84	6.48	6.24	6.49 /	9.22
41	13.08	11.47	8.46	7.70	7.32	7.03	6.81	6.47	6.21	6.43 /	9.42
42	13.84	12.15	8.87	7.99	7.49	7.17	6.91	6.56	6.30	6.52 /	9.90
43	14.13	12.45	8.99	8.01	7.41	7.12	6.87	6.50	6.23	6.35 /	9.05
44	14.89	13.21	9.34	8.20	7.54	7.22	6.92	6.55	6.26	6.75 /	9.36
45	14.70	12.98	9.22	8.15	7.55	7.21	6.93	6.56	6.29	6.66 /	9.57
46	14.79	13.06	9.17	8.10	7.50	7.18	6.88	6.52	6.29	6.58 /	9.49
S1	14.14	12.74	9.68	8.33	7.52	7.12	6.79	6.40	6.14	5.73 /	9.16
S2	14.11	12.74	9.63	8.29	7.45	7.04	6.72	6.32	6.07	5.77 /	8.98
S3	14.07	12.72	9.58	8.23	7.45	7.00	6.69	6.30	6.06	5.77 /	9.01
S4	13.89	12.54	9.42	8.16	7.41	7.00	6.69	6.33	6.08	5.77 /	9.02
S5	13.94	12.55	9.38	8.13	7.40	6.98	6.70	6.34	6.05	5.77 /	9.04

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・ブローカーズ、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	
S6	13.68	12.34	9.36	8.12	7.39	6.96	6.69	6.34	6.06	5.84 / 8.95
S7	13.68	12.36	9.38	8.13	7.44	7.00	6.69	6.35	6.08	5.82 / 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。