

PSJ 予測統計値
(平均値)

2006年 10月 2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・ピッチ日本, 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	13.30	12.61	9.67	8.35	7.63	7.18	6.82	6.38	6.00	5.81 / 9.06		
2	13.29	12.56	9.65	8.29	7.60	7.18	6.81	6.35	5.98	5.83 / 9.11		
3	13.38	12.69	9.69	8.34	7.64	7.19	6.83	6.39	6.02	5.92 / 9.17		
4	12.71	12.01	9.10	8.04	7.44	7.06	6.78	6.36	5.97	5.93 / 8.67		
5	12.55	11.85	9.00	7.94	7.39	7.00	6.77	6.34	5.95	6.02 / 8.56		
6	12.65	11.89	9.02	7.97	7.45	7.04	6.79	6.35	5.98	6.09 / 8.55		
7	12.72	11.95	9.05	8.00	7.48	7.11	6.82	6.43	6.05	6.19 / 9.27		
8	12.67	11.92	8.99	7.96	7.45	7.08	6.80	6.40	6.03	6.22 / 8.90		
9	12.29	11.50	8.78	7.86	7.34	6.98	6.74	6.30	5.97	6.13 / 8.44		
10	12.22	11.42	8.76	7.87	7.39	7.07	6.79	6.40	6.03	6.22 / 8.60		
11	12.11	11.27	8.60	7.79	7.32	7.00	6.74	6.33	5.99	5.95 / 8.27		
12	12.18	11.34	8.56	7.80	7.39	7.03	6.85	6.45	6.07	6.31 / 9.10		
13	12.27	11.43	8.66	7.86	7.41	7.05	6.84	6.43	6.09	5.92 / 9.33		
14	12.27	11.44	8.64	7.80	7.36	7.03	6.76	6.36	6.02	6.12 / 8.72		
15	12.25	11.40	8.62	7.81	7.38	7.04	6.77	6.41	6.02	6.05 / 8.88		
16	12.25	11.37	8.60	7.82	7.40	7.06	6.80	6.40	6.06	6.04 / 9.16		
17	12.16	11.30	8.57	7.76	7.36	7.03	6.78	6.38	6.03	5.98 / 8.89		
18	12.18	11.27	8.55	7.78	7.36	7.04	6.79	6.42	6.05	5.92 / 9.00		
19	12.12	11.24	8.55	7.76	7.35	7.02	6.79	6.39	6.06	5.92 / 9.01		
20	12.40	11.50	8.64	7.79	7.37	7.05	6.81	6.42	6.07	6.40 / 8.71		
21	12.46	11.54	8.63	7.82	7.44	7.14	6.86	6.47	6.11	6.54 / 9.17		
22	12.57	11.65	8.67	7.84	7.44	7.10	6.83	6.46	6.10	6.57 / 8.86		
23	12.77	11.84	8.76	7.88	7.47	7.12	6.87	6.47	6.11	6.55 / 8.79		
24	12.81	11.89	8.87	7.94	7.47	7.16	6.87	6.49	6.11	6.56 / 8.76		
25	12.61	11.66	8.65	7.80	7.43	7.11	6.87	6.45	6.11	6.58 / 8.55		
26	12.23	11.24	8.48	7.73	7.36	7.06	6.83	6.43	6.07	6.54 / 8.93		
27	12.04	11.07	8.37	7.66	7.35	7.06	6.82	6.46	6.11	6.44 / 8.58		
28	12.36	11.33	8.48	7.73	7.37	7.04	6.81	6.43	6.08	6.53 / 8.61		
29	12.02	10.97	8.35	7.70	7.39	7.09	6.86	6.49	6.14	6.36 / 9.08		
30	12.06	10.98	8.42	7.79	7.49	7.18	6.98	6.57	6.24	6.37 / 9.86		
31	11.77	10.71	8.25	7.63	7.34	7.07	6.86	6.51	6.12	6.32 / 9.20		
32	11.46	10.36	8.10	7.53	7.25	6.99	6.81	6.45	6.07	6.28 / 8.55		
33	11.87	10.77	8.26	7.60	7.32	7.04	6.85	6.47	6.12	6.35 / 8.83		
34	11.65	10.50	8.16	7.56	7.24	7.02	6.83	6.44	6.08	6.28 / 8.76		
35	11.73	10.58	8.16	7.55	7.25	6.97	6.80	6.43	6.05	6.29 / 8.59		
36	12.07	10.96	8.28	7.67	7.37	7.05	6.86	6.47	6.13	6.37 / 9.02		
37	12.05	10.91	8.32	7.63	7.32	7.03	6.82	6.48	6.11	6.35 / 8.88		
38	12.36	11.26	8.41	7.68	7.38	7.07	6.82	6.44	6.08	6.42 / 8.55		
39	12.36	11.21	8.40	7.70	7.42	7.10	6.90	6.51	6.17	6.39 / 9.28		
40	12.93	11.79	8.66	7.84	7.50	7.18	6.92	6.52	6.18	6.48 / 9.12		
41	12.55	11.34	8.48	7.72	7.40	7.11	6.89	6.50	6.15	6.39 / 9.35		
42	13.22	12.00	8.88	8.00	7.57	7.28	6.99	6.60	6.25	6.48 / 9.82		
43	13.52	12.33	9.01	8.01	7.55	7.24	6.95	6.53	6.17	6.57 / 8.95		
44	14.25	13.07	9.35	8.20	7.67	7.36	7.04	6.59	6.21	6.71 / 9.25		
45	14.10	12.87	9.24	8.16	7.69	7.35	7.05	6.60	6.23	6.65 / 9.46		
46	14.18	12.95	9.21	8.12	7.66	7.33	7.04	6.57	6.25	6.69 / 9.33		
47	14.23	12.94	9.14	8.07	7.65	7.32	7.02	6.56	6.24	6.76 / 9.07		
S1	13.30	12.50	9.71	8.42	7.69	7.28	6.92	6.44	6.08	5.85 / 9.13		
S2	13.27	12.49	9.65	8.37	7.62	7.19	6.83	6.35	6.00	5.91 / 9.11		
S3	13.23	12.48	9.62	8.32	7.62	7.16	6.81	6.35	5.99	5.91 / 9.11		
S4	13.10	12.31	9.45	8.25	7.58	7.15	6.80	6.37	6.01	5.90 / 8.95		

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	
S5	13.10	12.31	9.42	8.22	7.58	7.14	6.82	6.38	5.99	5.91 / 8.95
S6	12.93	12.14	9.40	8.21	7.50	7.09	6.79	6.38	6.00	5.99 / 8.89
S7	12.93	12.17	9.41	8.21	7.56	7.14	6.79	6.39	6.02	5.96 / 8.90
S8	12.86	12.08	9.35	8.17	7.53	7.11	6.78	6.37	6.01	5.98 / 8.74

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。