

PSJ 予測統計値
(中央値)

2006年 11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,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・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	12.12	12.07	8.68	7.84	7.47	7.07	6.95	6.56	6.28	5.75 /	8.99
2	12.27	12.27	8.85	7.85	7.37	7.22	6.94	6.50	6.24	5.77 /	8.95
3	12.50	12.50	8.68	7.91	7.53	7.23	6.91	6.64	6.24	5.87 /	9.01
4	11.64	11.61	8.23	7.84	7.36	7.19	6.79	6.53	6.11	5.93 /	8.63
5	11.47	11.41	8.75	7.66	7.32	7.06	6.78	6.39	6.09	6.03 /	8.50
6	11.61	11.61	8.46	7.80	7.30	7.13	6.80	6.50	6.10	6.09 /	8.51
7	11.85	11.85	8.45	7.82	7.37	7.03	6.91	6.60	6.40	6.20 /	9.21
8	11.76	11.67	8.32	7.86	7.28	7.15	6.84	6.59	6.40	6.22 /	8.90
9	11.70	11.65	8.33	7.94	7.30	7.15	6.86	6.48	6.02	6.15 /	8.41
10	11.67	11.51	8.33	7.91	7.29	7.15	6.86	6.54	6.43	6.18 /	8.50
11	11.43	11.24	8.27	7.96	7.31	7.00	6.90	6.52	6.19	5.89 /	8.19
12	11.13	10.88	8.14	7.78	7.31	7.06	7.00	6.51	6.43	6.33 /	9.01
13	11.31	11.07	8.22	7.97	7.50	7.09	6.96	6.42	6.34	5.87 /	9.23
14	11.38	11.17	8.33	7.93	7.23	6.93	6.93	6.43	6.35	6.07 /	8.62
15	11.33	11.08	8.28	7.89	7.24	6.94	6.94	6.43	6.36	6.00 /	8.78
16	11.26	11.01	8.20	7.88	7.32	7.03	6.95	6.43	6.36	6.00 /	9.06
17	11.29	10.99	8.22	7.82	7.32	7.00	6.97	6.49	6.43	5.94 /	8.85
18	11.25	10.96	8.17	7.82	7.33	7.09	6.99	6.43	6.38	5.87 /	8.91
19	11.20	10.86	8.25	7.71	7.30	7.08	6.98	6.46	6.40	5.87 /	8.91
20	11.87	11.36	8.43	7.71	7.26	7.03	6.93	6.48	6.43	6.44 /	8.61
21	11.82	11.27	8.50	7.60	7.36	7.07	6.92	6.59	6.53	6.59 /	9.07
22	12.16	11.38	8.56	7.71	7.25	7.02	6.92	6.53	6.49	6.62 /	8.77
23	12.22	11.41	8.58	7.76	7.26	7.08	6.91	6.58	6.54	6.63 /	8.75
24	11.96	11.28	8.54	7.68	7.49	7.02	6.88	6.63	6.59	6.62 /	8.66
25	11.48	10.89	8.41	7.64	7.33	6.98	6.86	6.65	6.53	6.63 /	8.44
26	11.23	10.67	8.20	7.61	7.14	6.96	6.86	6.48	6.44	6.58 /	8.84
27	10.26	10.03	7.95	7.54	7.30	6.93	6.81	6.71	6.65	6.44 /	8.48
28	10.85	10.41	8.17	7.69	7.33	6.90	6.74	6.60	6.59	6.52 /	8.51
29	10.17	9.95	7.97	7.76	7.34	6.97	6.78	6.67	6.61	6.38 /	9.04
30	10.14	9.94	8.01	7.75	7.37	6.93	6.76	6.48	6.61	6.36 /	9.76
31	9.93	9.75	7.90	7.72	7.17	6.85	6.74	6.66	6.36	6.31 /	9.11
32	9.77	9.59	7.80	7.51	7.07	6.81	6.75	6.66	6.48	6.27 /	8.46
33	10.12	9.92	7.96	7.40	7.12	6.91	6.76	6.66	6.61	6.34 /	8.74
34	9.79	9.62	7.78	7.54	7.03	6.89	6.74	6.61	6.40	6.27 /	8.67
35	9.89	9.71	7.80	7.66	7.05	6.80	6.68	6.64	6.47	6.29 /	8.57
36	10.30	10.04	7.94	7.69	7.22	6.91	6.73	6.64	6.59	6.36 /	8.93
37	10.19	9.93	7.89	7.47	7.02	6.88	6.72	6.63	6.58	6.34 /	8.80
38	10.58	10.29	8.02	7.66	7.41	6.97	6.68	6.64	6.56	6.41 /	8.52
39	10.42	10.15	7.94	7.54	7.30	6.93	6.73	6.65	6.58	6.38 /	9.17
40	11.06	10.71	8.20	7.70	7.52	7.01	6.73	6.57	6.59	6.46 /	9.00
41	10.55	10.23	7.97	7.54	7.27	6.93	6.57	6.44	6.44	6.41 /	9.24
42	11.08	10.66	8.04	7.68	7.36	7.04	6.76	6.63	6.57	6.47 /	9.72
43	11.75	10.99	8.18	7.73	7.54	7.16	6.73	6.64	6.56	6.55 /	8.80
44	12.87	12.01	8.45	7.80	7.61	7.27	6.80	6.58	6.58	6.69 /	9.06
45	12.45	11.60	8.56	7.73	7.57	7.24	6.75	6.62	6.57	6.63 /	9.28
46	12.68	11.77	8.58	7.75	7.58	7.20	6.76	6.62	6.57	6.68 /	9.16
47	12.71	11.81	8.55	7.74	7.58	7.21	6.78	6.56	6.55	6.70 /	8.90
48	11.60	10.78	8.27	7.62	7.46	7.10	6.78	6.72	6.55	6.55 /	9.16
S1	12.69	12.12	9.86	8.23	7.44	7.07	6.97	6.62	6.19	5.79 /	9.00
S2	12.86	12.09	9.82	8.15	7.45	7.09	6.95	6.58	6.19	5.89 /	8.95
S3	12.46	12.31	9.04	8.21	7.45	7.11	6.95	6.46	6.21	5.86 /	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・ブライザー、BNPパリバ、JPモルガン、みずほ、UBS、メリル・リンチ日本、大和SMBC、日興フィクグループ

回号	Yield Curve Scenarios (%)									最低 / 最高 (%)
	-300bp	-200bp	-100bp	-50bp	0bp	50bp	100bp	200bp	300bp	
S4	12.19	12.05	8.92	8.10	7.61	7.27	6.90	6.66	6.18	5.87 / 8.87
S5	12.42	12.42	8.57	7.82	7.61	7.19	6.97	6.74	6.16	5.87 / 8.89
S6	11.75	11.61	9.38	8.00	7.40	7.17	6.76	6.62	6.12	5.97 / 8.87
S7	11.78	11.58	9.38	8.00	7.56	7.36	6.76	6.63	6.13	5.94 / 8.88
S8	11.74	11.56	9.36	7.98	7.55	7.34	6.76	6.69	6.37	5.91 / 9.32
S9	11.75	11.41	9.18	7.85	7.51	7.33	6.80	6.65	6.11	5.77 / 8.89

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。