

PSJ 予測統計値
(平均値)

2006年 12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	13.27	12.62	9.76	8.40	7.62	7.16	6.80	6.34	5.99	5.81 /	9.39
2	13.27	12.61	9.74	8.35	7.60	7.16	6.79	6.32	5.98	5.84 /	9.27
3	13.37	12.73	9.79	8.41	7.64	7.19	6.82	6.37	6.02	5.92 /	9.39
4	12.72	12.07	9.19	8.11	7.45	7.05	6.80	6.35	5.98	6.00 /	8.92
5	12.58	11.94	9.10	8.03	7.42	7.03	6.81	6.34	5.97	6.11 /	8.59
6	12.66	11.97	9.12	8.05	7.47	7.04	6.81	6.35	6.00	6.16 /	8.63
7	12.73	12.03	9.15	8.09	7.50	7.11	6.84	6.43	6.07	6.27 /	9.47
8	12.67	12.00	9.08	8.05	7.47	7.09	6.82	6.40	6.05	6.29 /	9.15
9	12.30	11.58	8.84	7.92	7.34	6.97	6.75	6.30	5.99	6.20 /	8.42
10	12.24	11.50	8.82	7.93	7.39	7.06	6.80	6.40	6.04	6.24 /	8.65
11	12.12	11.37	8.65	7.85	7.31	6.98	6.76	6.32	6.01	5.94 /	8.30
12	12.19	11.46	8.62	7.85	7.39	7.05	6.87	6.44	6.09	6.40 /	9.16
13	12.28	11.54	8.73	7.92	7.42	7.05	6.86	6.42	6.11	5.92 /	9.39
14	12.30	11.56	8.72	7.88	7.38	7.02	6.78	6.36	6.04	6.12 /	8.79
15	12.26	11.51	8.68	7.87	7.38	7.03	6.78	6.40	6.04	6.05 /	8.93
16	12.26	11.48	8.67	7.89	7.40	7.06	6.81	6.39	6.07	6.05 /	9.21
17	12.17	11.42	8.64	7.83	7.37	7.03	6.80	6.38	6.06	5.99 /	9.00
18	12.19	11.39	8.62	7.85	7.37	7.03	6.81	6.42	6.07	5.92 /	9.12
19	12.12	11.36	8.61	7.83	7.35	7.01	6.80	6.39	6.07	5.92 /	9.04
20	12.41	11.62	8.71	7.86	7.38	7.05	6.82	6.42	6.08	6.50 /	8.74
21	12.45	11.66	8.70	7.89	7.44	7.13	6.88	6.47	6.13	6.64 /	9.19
22	12.56	11.76	8.76	7.91	7.44	7.09	6.84	6.46	6.11	6.67 /	8.90
23	12.76	11.95	8.85	7.96	7.48	7.12	6.89	6.47	6.13	6.69 /	8.88
24	12.79	12.00	8.96	8.02	7.48	7.16	6.89	6.50	6.13	6.71 /	8.86
25	12.58	11.76	8.73	7.88	7.43	7.10	6.88	6.45	6.12	6.69 /	8.56
26	12.23	11.39	8.54	7.80	7.36	7.08	6.85	6.43	6.09	6.64 /	8.93
27	12.02	11.20	8.43	7.73	7.35	7.07	6.83	6.46	6.13	6.54 /	8.56
28	12.33	11.45	8.55	7.80	7.36	7.05	6.82	6.43	6.09	6.63 /	8.60
29	12.00	11.12	8.41	7.78	7.40	7.11	6.89	6.50	6.16	6.48 /	9.11
30	12.04	11.13	8.47	7.87	7.49	7.21	7.00	6.58	6.27	6.47 /	9.91
31	11.75	10.86	8.29	7.70	7.34	7.08	6.87	6.50	6.14	6.41 /	9.17
32	11.45	10.50	8.13	7.59	7.23	7.00	6.82	6.44	6.08	6.35 /	8.62
33	11.83	10.91	8.30	7.67	7.31	7.05	6.86	6.46	6.13	6.43 /	8.80
34	11.63	10.67	8.20	7.63	7.23	7.04	6.84	6.43	6.09	6.36 /	8.72
35	11.72	10.76	8.22	7.63	7.25	7.00	6.82	6.43	6.08	6.36 /	8.66
36	12.04	11.12	8.35	7.76	7.39	7.07	6.89	6.48	6.16	6.46 /	9.07
37	12.00	11.06	8.36	7.71	7.32	7.05	6.83	6.47	6.12	6.42 /	8.86
38	12.30	11.38	8.48	7.76	7.38	7.06	6.84	6.44	6.10	6.50 /	8.68
39	12.30	11.34	8.44	7.78	7.41	7.11	6.90	6.50	6.18	6.47 /	9.23
40	12.86	11.90	8.74	7.94	7.50	7.17	6.92	6.51	6.19	6.56 /	9.10
41	12.47	11.47	8.54	7.81	7.40	7.10	6.90	6.50	6.16	6.48 /	9.30
42	13.13	12.11	8.95	8.10	7.58	7.27	7.00	6.60	6.26	6.58 /	9.79
43	13.42	12.42	9.10	8.12	7.56	7.23	6.95	6.52	6.18	6.66 /	8.92
44	14.15	13.15	9.52	8.33	7.69	7.35	7.01	6.58	6.22	6.81 /	9.27
45	13.96	12.92	9.35	8.26	7.68	7.33	7.01	6.58	6.23	6.74 /	9.45
46	14.11	13.08	9.37	8.26	7.68	7.34	7.02	6.57	6.26	6.79 /	9.35
47	14.15	13.08	9.30	8.21	7.67	7.33	7.01	6.56	6.25	6.81 /	9.06
48	13.54	12.43	8.93	8.06	7.57	7.25	6.99	6.56	6.26	6.65 /	9.23
49	13.50	12.39	8.86	7.97	7.50	7.18	6.93	6.48	6.19	6.70 /	8.89
S1	13.29	12.54	9.81	8.49	7.70	7.28	6.91	6.43	6.09	5.85 /	9.39
S2	13.26	12.54	9.75	8.44	7.64	7.20	6.85	6.35	6.02	5.96 /	9.27

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、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	
S3	13.22	12.53	9.73	8.40	7.64	7.17	6.82	6.34	6.01	5.96 / 9.33
S4	13.11	12.39	9.56	8.33	7.61	7.16	6.82	6.37	6.03	5.93 / 9.20
S5	13.11	12.39	9.53	8.30	7.60	7.15	6.84	6.38	6.01	5.94 / 9.22
S6	12.97	12.23	9.51	8.30	7.54	7.10	6.82	6.37	6.01	6.04 / 9.23
S7	12.96	12.25	9.53	8.30	7.58	7.14	6.82	6.38	6.03	6.01 / 9.24
S8	12.94	12.23	9.49	8.28	7.58	7.14	6.82	6.38	6.04	6.03 / 9.24
S9	12.87	12.15	9.42	8.22	7.54	7.11	6.80	6.36	6.03	5.83 / 9.19

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。