

P S J 予測統計値
(中央値)

2006年 8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,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,JPモルガン,みずほ,UBS,メルリッチ日本,大和SMB,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	13.09	12.33	8.19	7.56	7.27	7.01	6.83	6.59	6.16	5.24 /	8.81
2	13.16	12.44	8.21	7.48	7.23	7.02	6.76	6.52	6.14	5.28 /	8.76
3	13.27	12.56	8.24	7.52	7.23	6.95	6.72	6.49	6.12	5.42 /	8.80
4	12.57	11.93	8.20	7.41	7.13	6.81	6.71	6.48	6.06	5.44 /	8.53
5	12.91	12.15	8.35	7.45	7.12	6.83	6.74	6.36	6.03	5.57 /	8.29
6	12.76	12.05	8.27	7.55	7.11	6.81	6.71	6.40	6.06	5.61 /	8.31
7	12.59	11.87	8.24	7.53	7.04	6.79	6.69	6.39	6.04	5.77 /	9.14
8	12.59	11.64	8.26	7.58	7.06	6.83	6.70	6.38	6.04	5.76 /	8.82
9	12.49	11.52	8.22	7.57	7.07	6.86	6.68	6.27	5.97	5.68 /	8.16
10	12.43	11.37	8.15	7.48	7.09	6.84	6.73	6.36	6.09	5.82 /	8.52
11	12.01	11.10	8.10	7.43	7.06	6.84	6.71	6.29	6.07	5.76 /	8.23
12	11.61	10.83	8.03	7.35	7.10	6.90	6.79	6.34	6.20	5.88 /	9.03
13	11.88	10.89	8.09	7.40	7.07	6.85	6.71	6.28	6.11	5.75 /	9.29
14	11.93	10.98	8.10	7.43	7.06	6.84	6.73	6.30	6.13	5.83 /	8.69
15	11.91	10.91	8.08	7.40	7.06	6.86	6.75	6.30	6.14	5.87 /	8.80
16	11.83	10.84	8.06	7.38	7.06	6.86	6.76	6.29	6.14	5.87 /	9.07
17	11.81	10.83	8.09	7.40	7.06	6.85	6.72	6.26	6.12	5.81 /	8.85
18	11.67	10.70	8.09	7.33	7.06	6.85	6.71	6.26	6.13	5.76 /	8.96
19	11.63	10.65	8.08	7.37	7.03	6.85	6.68	6.24	6.12	5.75 /	8.97
20	12.49	10.71	8.09	7.36	7.05	6.83	6.69	6.28	6.16	5.97 /	8.68
21	12.44	10.61	8.04	7.38	7.05	6.81	6.65	6.27	6.14	6.13 /	9.10
22	12.56	10.82	8.09	7.40	7.07	6.85	6.64	6.25	6.13	6.13 /	8.78
23	12.53	10.83	8.09	7.53	7.08	6.87	6.67	6.29	6.16	6.13 /	9.14
24	12.42	10.77	8.06	7.57	7.21	6.88	6.65	6.29	6.17	6.14 /	8.73
25	12.05	10.61	7.98	7.56	7.18	6.83	6.65	6.30	6.19	6.15 /	8.51
26	11.85	10.23	7.83	7.41	7.08	6.75	6.57	6.27	6.15	6.11 /	8.91
27	11.32	10.01	7.80	7.47	7.19	6.73	6.51	6.21	6.12	6.16 /	8.46
28	11.65	10.26	7.88	7.50	7.18	6.73	6.56	6.29	6.18	6.14 /	8.53
29	11.15	9.93	7.77	7.44	7.17	6.71	6.49	6.21	6.12	6.22 /	8.99
30	11.11	9.91	7.75	7.40	7.14	6.72	6.48	6.18	6.13	6.24 /	9.75
31	10.93	9.74	7.70	7.37	7.11	6.68	6.45	6.19	6.13	6.16 /	9.11
32	10.76	9.59	7.66	7.33	7.08	6.66	6.44	6.26	6.16	6.19 /	8.46
33	11.03	9.84	7.71	7.37	7.11	6.67	6.46	6.23	6.13	6.19 /	8.68
34	10.71	9.56	7.64	7.29	7.05	6.72	6.42	6.22	6.13	6.14 /	8.61
35	10.82	9.65	7.64	7.32	7.06	6.73	6.44	6.23	6.13	6.16 /	8.51
36	11.23	9.95	7.74	7.38	7.11	6.70	6.49	6.25	6.15	6.22 /	8.93
37	11.13	9.87	7.70	7.34	7.10	6.76	6.48	6.25	6.14	6.21 /	8.80
38	11.40	10.14	7.78	7.40	7.15	6.76	6.53	6.29	6.18	6.27 /	8.49
39	11.25	9.98	7.70	7.35	7.10	6.70	6.49	6.27	6.17	6.24 /	9.17
40	11.80	10.46	7.88	7.45	7.17	6.85	6.60	6.37	6.26	6.37 /	9.00
41	11.42	10.08	7.72	7.36	7.10	6.80	6.52	6.30	6.19	6.31 /	9.23
42	11.82	10.47	7.85	7.44	7.14	6.89	6.58	6.26	6.15	6.38 /	9.75
43	12.28	10.91	8.00	7.50	7.18	6.99	6.62	6.28	6.15	6.46 /	8.87
44	13.08	11.44	8.25	7.62	7.29	7.00	6.74	6.44	6.31	6.60 /	9.07
45	12.75	11.21	8.13	7.56	7.30	7.02	6.76	6.45	6.32	6.57 /	9.37
S1	13.32	12.32	8.71	7.58	7.18	6.93	6.79	6.68	6.14	5.35 /	8.73
S2	13.41	12.48	8.90	7.59	7.17	6.94	6.69	6.42	6.03	5.36 /	8.61
S3	13.23	12.47	8.35	7.62	7.14	6.93	6.68	6.39	5.97	5.38 /	8.62
S4	13.03	12.34	8.27	7.65	7.22	6.89	6.65	6.41	6.05	5.40 /	8.67
S5	12.91	12.15	8.27	7.66	7.19	6.88	6.64	6.36	6.05	5.47 /	8.65
S6	13.12	12.22	8.66	7.73	7.23	6.84	6.62	6.42	6.06	5.49 /	8.58

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、JPモルガン、みずほ、UBS、メリリヤ日本、大和SMBC、日興シイグループ

回号	Yield Curve Scenarios (%)									最低 / 最高 (%)
	-300bp	-200bp	-100bp	-50bp	0bp	50bp	100bp	200bp	300bp	
S7	13.01	12.21	8.68	7.73	7.22	6.85	6.63	6.42	6.06	5.47 / 8.56

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。