

PSJ 予測統計値
(平均値)

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・ブザーク,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	13.40	12.47	9.02	7.94	7.36	6.94	6.67	6.31	6.03	5.24 /	8.81
2	13.35	12.40	8.96	7.91	7.35	6.94	6.66	6.31	6.02	5.28 /	8.76
3	13.46	12.49	9.00	7.94	7.36	6.95	6.67	6.31	6.02	5.42 /	8.80
4	12.83	11.84	8.59	7.69	7.23	6.87	6.62	6.28	5.98	5.44 /	8.53
5	12.72	11.69	8.53	7.64	7.20	6.87	6.62	6.27	5.97	5.57 /	8.29
6	12.78	11.75	8.55	7.66	7.22	6.88	6.64	6.29	5.99	5.61 /	8.31
7	12.81	11.75	8.55	7.69	7.26	6.93	6.68	6.33	6.03	5.77 /	9.14
8	12.80	11.73	8.53	7.68	7.25	6.90	6.66	6.31	6.02	5.76 /	8.82
9	12.43	11.31	8.35	7.57	7.16	6.83	6.60	6.26	5.98	5.68 /	8.16
10	12.34	11.20	8.34	7.60	7.20	6.88	6.65	6.31	6.02	5.82 /	8.52
11	12.25	11.02	8.23	7.51	7.13	6.82	6.59	6.27	5.98	5.76 /	8.23
12	12.31	11.07	8.19	7.55	7.19	6.89	6.67	6.34	6.06	5.88 /	9.03
13	12.33	11.09	8.25	7.57	7.20	6.89	6.67	6.34	6.05	5.75 /	9.29
14	12.36	11.18	8.24	7.55	7.16	6.85	6.62	6.29	6.01	5.83 /	8.69
15	12.36	11.14	8.24	7.55	7.17	6.87	6.64	6.31	6.02	5.87 /	8.80
16	12.34	11.10	8.24	7.56	7.18	6.88	6.65	6.32	6.03	5.87 /	9.07
17	12.29	11.04	8.21	7.54	7.16	6.86	6.63	6.31	6.02	5.81 /	8.85
18	12.25	10.99	8.19	7.53	7.16	6.86	6.64	6.31	6.02	5.76 /	8.96
19	12.23	10.97	8.18	7.53	7.16	6.86	6.64	6.31	6.03	5.75 /	8.97
20	12.56	11.27	8.27	7.56	7.21	6.90	6.68	6.35	6.06	5.97 /	8.68
21	12.60	11.27	8.27	7.62	7.27	6.96	6.73	6.39	6.10	6.13 /	9.10
22	12.72	11.41	8.30	7.64	7.26	6.94	6.71	6.38	6.08	6.13 /	8.78
23	13.03	11.69	8.43	7.70	7.33	7.01	6.77	6.42	6.13	6.13 /	9.14
24	13.01	11.68	8.50	7.72	7.32	7.01	6.77	6.42	6.13	6.14 /	8.73
25	12.81	11.45	8.33	7.63	7.28	6.97	6.74	6.40	6.11	6.15 /	8.51
26	12.41	10.99	8.18	7.60	7.21	6.92	6.70	6.37	6.07	6.11 /	8.91
27	12.21	10.81	8.08	7.49	7.19	6.91	6.70	6.38	6.09	6.16 /	8.46
28	12.55	11.11	8.18	7.54	7.22	6.92	6.70	6.38	6.08	6.14 /	8.53
29	12.15	10.69	8.09	7.51	7.22	6.94	6.73	6.42	6.12	6.22 /	8.99
30	12.14	10.60	8.12	7.58	7.28	7.01	6.80	6.47	6.18	6.24 /	9.75
31	11.92	10.39	8.00	7.55	7.19	6.92	6.72	6.41	6.11	6.16 /	9.11
32	11.63	10.09	7.88	7.46	7.12	6.87	6.67	6.37	6.08	6.19 /	8.46
33	12.02	10.48	8.00	7.54	7.18	6.91	6.71	6.39	6.10	6.19 /	8.68
34	11.83	10.22	7.93	7.47	7.14	6.88	6.68	6.37	6.08	6.14 /	8.61
35	11.95	10.32	7.94	7.49	7.15	6.88	6.68	6.37	6.08	6.16 /	8.51
36	12.25	10.70	8.06	7.52	7.22	6.94	6.73	6.41	6.12	6.22 /	8.93
37	12.27	10.67	8.09	7.57	7.21	6.93	6.73	6.41	6.11	6.21 /	8.80
38	12.58	11.04	8.18	7.54	7.23	6.94	6.73	6.40	6.11	6.27 /	8.49
39	12.53	10.85	8.15	7.54	7.25	6.97	6.76	6.44	6.14	6.24 /	9.17
40	13.11	11.50	8.35	7.67	7.32	7.02	6.79	6.46	6.16	6.37 /	9.00
41	12.80	11.09	8.25	7.61	7.30	7.01	6.80	6.47	6.17	6.31 /	9.23
42	13.37	11.64	8.58	7.81	7.41	7.10	6.87	6.52	6.22	6.38 /	9.75
43	13.75	12.08	8.66	7.84	7.39	7.07	6.82	6.47	6.17	6.46 /	8.87
44	14.44	12.77	8.92	8.01	7.54	7.17	6.90	6.53	6.23	6.60 /	9.07
45	14.29	12.55	8.85	7.98	7.51	7.17	6.91	6.55	6.25	6.57 /	9.37
S1	13.50	12.36	9.02	7.95	7.39	7.00	6.73	6.37	6.08	5.35 /	8.73
S2	13.36	12.32	9.03	7.94	7.36	6.97	6.68	6.32	6.03	5.36 /	8.61
S3	13.33	12.32	8.97	7.90	7.33	6.93	6.64	6.29	6.00	5.38 /	8.62
S4	13.21	12.18	8.88	7.85	7.32	6.92	6.65	6.30	6.01	5.40 /	8.67
S5	13.14	12.11	8.81	7.81	7.28	6.90	6.63	6.28	6.00	5.47 /	8.65
S6	13.03	12.02	8.85	7.81	7.28	6.91	6.64	6.30	6.02	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	13.00	12.00	8.84	7.80	7.26	6.90	6.64	6.30	6.02	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。