

PSJ 予測統計値
(中央値)

2006年 9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,メルガン・スチール,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	12.21	12.21	9.00	7.86	7.28	6.96	6.77	6.65	6.37	5.66 /	9.09
2	12.31	12.31	8.90	7.89	7.29	6.92	6.78	6.64	6.34	5.68 /	9.04
3	12.57	12.57	9.03	7.91	7.40	7.02	6.78	6.61	6.28	5.83 /	9.10
4	11.84	11.84	8.45	7.63	7.22	6.78	6.78	6.58	6.17	5.79 /	8.74
5	12.74	12.37	8.78	7.65	7.06	6.80	6.78	6.45	6.16	5.88 /	8.55
6	12.23	12.23	8.66	7.80	7.17	6.83	6.83	6.53	6.16	5.95 /	8.58
7	11.90	11.90	8.45	7.80	7.26	7.02	6.87	6.64	6.28	6.04 /	9.35
8	11.83	11.78	8.48	7.74	7.24	6.85	6.85	6.66	6.27	6.07 /	8.99
9	11.75	11.75	8.51	7.83	7.19	6.88	6.88	6.53	6.09	5.98 /	8.44
10	11.69	11.63	8.43	7.90	7.21	6.90	6.90	6.56	6.35	6.06 /	8.67
11	11.45	11.36	8.37	7.79	7.10	6.91	6.91	6.57	6.30	5.96 /	8.34
12	11.15	11.02	8.33	7.66	7.26	7.03	6.94	6.59	6.37	6.14 /	9.15
13	11.34	11.24	8.40	7.80	7.18	7.04	6.94	6.51	6.30	5.93 /	9.42
14	11.44	11.30	8.41	7.89	7.12	6.97	6.87	6.45	6.25	6.10 /	8.82
15	11.38	11.25	8.37	7.85	7.20	6.95	6.91	6.52	6.30	6.06 /	8.97
16	11.30	11.15	8.36	7.77	7.16	7.02	6.93	6.48	6.28	6.06 /	9.20
17	11.32	11.15	8.39	7.61	7.21	7.04	6.94	6.55	6.33	6.00 /	8.98
18	11.28	11.13	8.40	7.74	7.21	7.04	6.94	6.55	6.33	5.93 /	9.10
19	11.24	11.05	8.36	7.69	7.25	7.03	6.94	6.58	6.36	5.93 /	9.10
20	11.90	11.42	8.46	7.63	7.21	6.99	6.88	6.61	6.41	6.22 /	8.81
21	11.86	11.30	8.49	7.59	7.20	7.03	6.95	6.74	6.52	6.35 /	9.26
22	12.20	11.42	8.57	7.58	7.22	6.97	6.85	6.67	6.47	6.38 /	8.91
23	12.22	11.47	8.59	7.68	7.22	6.96	6.85	6.73	6.53	6.38 /	9.36
24	12.00	11.36	8.53	7.67	7.20	7.02	6.83	6.71	6.57	6.39 /	8.86
25	11.50	11.04	8.43	7.62	7.18	6.93	6.80	6.68	6.62	6.39 /	8.65
26	11.23	10.80	8.20	7.50	7.21	7.01	6.82	6.63	6.42	6.32 /	9.02
27	10.37	10.19	8.11	7.45	7.15	6.96	6.76	6.66	6.61	6.40 /	8.65
28	10.89	10.60	8.18	7.47	7.10	6.86	6.76	6.65	6.58	6.37 /	8.65
29	10.24	10.09	8.03	7.60	7.37	7.02	6.73	6.63	6.59	6.38 /	9.14
30	10.23	10.10	8.02	7.57	7.42	6.99	6.74	6.48	6.59	6.38 /	9.92
31	10.01	9.96	7.92	7.31	7.18	6.91	6.72	6.62	6.37	6.27 /	9.26
32	9.85	9.76	7.83	7.42	7.10	6.87	6.72	6.64	6.51	6.10 /	8.60
33	10.21	10.04	7.98	7.33	7.10	6.96	6.73	6.63	6.59	6.33 /	8.88
34	9.84	9.72	7.80	7.30	7.03	6.91	6.69	6.63	6.44	6.07 /	8.75
35	9.96	9.82	7.84	7.22	7.00	6.87	6.70	6.62	6.51	6.15 /	8.65
36	10.39	10.20	8.00	7.56	7.19	6.98	6.71	6.63	6.57	6.39 /	9.09
37	10.28	10.08	7.93	7.35	7.01	6.95	6.70	6.62	6.57	6.31 /	8.94
38	10.68	10.46	8.07	7.39	6.98	6.98	6.70	6.63	6.58	6.44 /	8.63
39	10.52	10.29	8.03	7.49	7.24	6.97	6.72	6.64	6.57	6.42 /	9.35
40	11.16	10.83	8.23	7.69	7.19	6.99	6.74	6.63	6.57	6.49 /	9.22
41	10.64	10.38	8.01	7.33	6.95	6.94	6.65	6.46	6.46	6.43 /	9.42
42	11.22	10.79	8.18	7.68	7.35	7.12	6.83	6.65	6.55	6.52 /	9.90
43	11.90	11.15	8.35	7.72	7.07	6.93	6.79	6.65	6.55	6.35 /	9.05
44	12.89	12.18	8.62	7.80	7.21	6.91	6.78	6.62	6.56	6.75 /	9.36
45	12.57	11.77	8.58	7.75	7.13	6.90	6.76	6.66	6.56	6.66 /	9.57
46	12.83	11.95	8.44	7.74	7.13	6.91	6.79	6.41	6.36	6.58 /	9.49
S1	13.57	12.73	9.91	8.04	7.43	6.95	6.76	6.76	6.30	5.73 /	9.16
S2	13.07	12.90	9.60	8.11	7.43	6.94	6.76	6.66	6.30	5.77 /	8.98
S3	12.82	12.82	9.20	8.05	7.44	6.95	6.74	6.63	6.31	5.77 /	9.01
S4	12.69	12.69	9.07	7.96	7.45	6.89	6.76	6.76	6.25	5.77 /	9.02
S5	12.34	12.34	8.73	7.88	7.57	7.16	7.08	6.81	6.26	5.77 /	9.04

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・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	
S6	13.03	12.50	9.27	7.96	7.38	6.81	6.77	6.71	6.18	5.84 / 8.95
S7	13.01	12.52	9.28	7.97	7.38	6.81	6.77	6.72	6.20	5.82 / 8.95

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。