

PSJ 予測統計値  
(中央値)

2006年 10月 16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	12.16	12.08	8.59	7.86	7.52	7.10	6.95	6.59	6.28	5.65 /	8.87
2	12.30	12.30	8.87	7.87	7.45	7.02	6.88	6.52	6.27	5.66 /	8.91
3	12.52	12.52	8.61	7.92	7.57	6.99	6.87	6.59	6.27	5.75 /	8.97
4	11.63	11.60	8.26	7.86	7.25	6.99	6.80	6.52	6.11	5.79 /	8.54
5	11.47	11.37	8.73	7.69	7.18	6.89	6.78	6.43	6.10	5.90 /	8.42
6	11.64	11.58	8.30	7.80	7.20	7.00	6.81	6.54	6.09	5.97 /	8.42
7	11.87	11.87	8.47	7.83	7.39	7.03	6.81	6.57	6.24	6.07 /	9.09
8	11.78	11.61	8.30	7.88	7.16	6.94	6.83	6.58	6.26	6.11 /	8.71
9	11.66	11.54	8.33	7.93	7.12	6.95	6.84	6.51	6.06	6.03 /	8.31
10	11.68	11.45	8.34	7.91	7.18	7.01	6.87	6.55	6.30	6.11 /	8.45
11	11.45	11.13	8.24	7.78	7.16	6.99	6.89	6.56	6.17	5.85 /	8.11
12	11.16	10.77	8.16	7.72	7.27	7.05	6.96	6.60	6.36	6.25 /	8.94
13	11.34	10.95	8.21	7.77	7.29	6.97	6.97	6.49	6.24	5.82 /	9.16
14	11.40	11.02	8.32	7.83	7.24	6.94	6.87	6.50	6.25	6.01 /	8.55
15	11.35	10.97	8.26	7.80	7.21	6.96	6.89	6.56	6.30	5.95 /	8.71
16	11.28	10.86	8.18	7.75	7.27	7.00	6.95	6.54	6.30	5.95 /	8.99
17	11.31	10.90	8.17	7.67	7.28	7.01	6.94	6.55	6.31	5.89 /	8.72
18	11.27	10.83	8.13	7.73	7.27	7.01	6.95	6.48	6.25	5.83 /	8.85
19	11.23	10.77	8.28	7.70	7.25	7.00	6.93	6.54	6.30	5.82 /	8.85
20	11.87	11.15	8.42	7.63	7.20	7.01	6.89	6.62	6.37	6.33 /	8.56
21	11.85	11.04	8.40	7.59	7.39	7.08	6.88	6.75	6.50	6.48 /	9.02
22	12.15	11.18	8.43	7.64	7.20	6.97	6.87	6.69	6.44	6.51 /	8.71
23	12.18	11.19	8.48	7.73	7.21	7.10	6.86	6.75	6.50	6.49 /	8.63
24	11.95	11.08	8.40	7.64	7.40	7.02	6.86	6.74	6.55	6.51 /	8.60
25	11.47	10.73	8.23	7.64	7.28	6.96	6.84	6.69	6.47	6.52 /	8.40
26	11.22	10.45	8.12	7.61	7.16	6.99	6.84	6.62	6.37	6.49 /	8.79
27	10.32	9.99	7.95	7.54	7.31	6.94	6.78	6.68	6.61	6.36 /	8.47
28	10.86	10.29	8.07	7.64	7.28	6.86	6.75	6.65	6.56	6.44 /	8.47
29	10.19	9.90	7.94	7.74	7.33	6.92	6.74	6.64	6.58	6.32 /	8.97
30	10.16	9.94	7.94	7.73	7.31	6.90	6.73	6.48	6.60	6.31 /	9.75
31	9.96	9.73	7.84	7.69	7.18	6.80	6.72	6.64	6.36	6.26 /	9.10
32	9.79	9.59	7.77	7.54	7.08	6.79	6.72	6.63	6.50	6.22 /	8.49
33	10.13	9.88	7.93	7.41	7.09	6.86	6.72	6.65	6.59	6.29 /	8.73
34	9.82	9.60	7.76	7.58	7.05	6.91	6.71	6.62	6.43	6.23 /	8.66
35	9.90	9.66	7.74	7.63	7.03	6.77	6.68	6.63	6.50	6.24 /	8.52
36	10.34	10.02	7.87	7.67	7.21	6.87	6.70	6.62	6.56	6.31 /	8.92
37	10.20	9.89	7.86	7.48	7.01	6.87	6.71	6.62	6.58	6.30 /	8.79
38	10.61	10.24	7.96	7.66	7.35	6.93	6.69	6.62	6.57	6.36 /	8.55
39	10.44	10.10	7.87	7.54	7.28	6.89	6.71	6.63	6.58	6.35 /	9.16
40	11.09	10.57	8.12	7.67	7.47	7.00	6.71	6.62	6.57	6.43 /	8.99
41	10.55	10.18	7.89	7.56	7.29	6.89	6.53	6.45	6.45	6.34 /	9.23
42	11.10	10.52	8.01	7.65	7.38	7.05	6.75	6.63	6.56	6.44 /	9.69
43	11.79	10.86	8.16	7.70	7.49	7.12	6.73	6.63	6.55	6.51 /	8.78
44	12.87	11.78	8.39	7.78	7.58	7.28	6.82	6.60	6.57	6.64 /	9.02
45	12.47	11.35	8.48	7.71	7.54	7.21	6.74	6.64	6.56	6.58 /	9.26
46	12.65	11.49	8.51	7.73	7.55	7.22	6.75	6.66	6.56	6.62 /	9.11
47	12.84	11.58	8.53	7.72	7.55	7.13	6.77	6.57	6.56	6.67 /	8.84
S1	12.69	12.06	9.86	8.01	7.46	7.13	6.97	6.64	6.22	5.68 /	8.93
S2	12.87	12.07	9.81	8.04	7.47	7.14	6.94	6.51	6.21	5.73 /	8.91
S3	12.44	12.24	8.79	8.04	7.47	7.15	6.94	6.54	6.24	5.73 /	8.91
S4	12.16	11.96	8.67	8.01	7.54	7.30	6.89	6.66	6.20	5.75 /	8.74

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・ブローカーズ、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	
S5	12.42	12.40	8.55	7.83	7.56	7.25	7.05	6.74	6.18	5.75 / 8.74
S6	11.73	11.52	9.23	7.98	7.43	7.19	6.76	6.60	6.16	5.83 / 8.69
S7	11.70	11.49	9.25	7.95	7.44	7.38	6.76	6.60	6.15	5.82 / 8.69
S8	11.75	11.36	9.26	7.93	7.43	7.40	6.76	6.57	6.16	5.84 / 8.67

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。