

PSJ 予測統計値
(中央値)

2006年 12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・ピッチ日本,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	12.02	12.02	9.07	8.26	7.44	7.12	7.05	6.53	6.25	5.93 / 9.61
2	12.01	12.01	8.99	7.94	7.44	7.11	7.04	6.49	6.19	5.97 / 9.49
3	12.23	12.23	9.07	7.95	7.56	7.12	7.02	6.57	6.33	6.05 / 9.61
4	11.57	11.57	8.64	7.89	7.50	7.08	6.81	6.51	6.23	6.12 / 9.14
5	11.25	11.25	8.94	7.75	7.61	7.06	6.79	6.45	6.09	6.22 / 8.81
6	11.53	11.53	8.83	7.90	7.69	7.04	6.80	6.55	6.09	6.28 / 8.84
7	11.80	11.80	8.59	7.95	7.60	7.03	6.96	6.61	6.34	6.39 / 9.69
8	11.59	11.59	8.59	7.97	7.59	7.01	6.82	6.60	6.37	6.42 / 9.37
9	11.57	11.57	8.43	8.00	7.37	7.00	6.85	6.51	6.05	6.26 / 8.45
10	11.51	11.51	8.41	7.98	7.44	7.02	6.85	6.51	6.37	6.27 / 8.87
11	11.32	11.32	8.35	8.03	7.35	7.00	6.89	6.44	6.37	5.96 / 8.53
12	11.05	11.05	8.33	8.04	7.31	7.02	7.00	6.34	6.39	6.43 / 9.41
13	11.22	11.22	8.40	8.15	7.53	6.96	6.96	6.35	6.32	5.93 / 9.64
14	11.29	11.29	8.40	7.99	7.39	6.93	6.90	6.40	6.29	6.14 / 9.02
15	11.24	11.24	8.35	8.02	7.34	6.94	6.94	6.35	6.34	6.06 / 9.18
16	11.17	11.15	8.35	8.08	7.33	6.95	6.94	6.32	6.33	6.06 / 9.46
17	11.19	11.16	8.38	8.00	7.34	6.96	6.94	6.33	6.33	5.99 / 9.24
18	11.16	11.13	8.40	8.11	7.38	6.98	6.98	6.31	6.32	5.93 / 9.36
19	11.08	11.07	8.38	8.10	7.39	6.98	6.98	6.29	6.35	5.93 / 9.29
20	11.85	11.61	8.69	7.84	7.32	7.02	6.96	6.25	6.41	6.56 / 8.98
21	11.80	11.50	8.61	7.95	7.41	7.10	6.96	6.32	6.52	6.70 / 9.44
22	12.13	11.66	8.82	8.02	7.42	7.07	6.96	6.28	6.49	6.71 / 9.14
23	12.14	11.71	8.84	8.03	7.42	7.09	6.95	6.32	6.52	6.74 / 9.13
24	11.97	11.56	8.77	7.96	7.53	7.08	6.92	6.34	6.57	6.76 / 9.11
25	11.45	11.30	8.62	7.77	7.36	7.04	6.88	6.38	6.61	6.74 / 8.80
26	11.19	11.08	8.46	7.76	7.27	7.01	6.89	6.20	6.43	6.63 / 9.17
27	9.96	9.88	8.45	7.72	7.35	6.99	6.85	6.44	6.67	6.66 / 8.75
28	10.82	10.64	8.55	7.74	7.35	6.97	6.75	6.31	6.59	6.67 / 8.82
29	9.86	9.79	8.21	7.79	7.44	6.99	6.82	6.43	6.64	6.56 / 9.30
30	9.84	9.77	8.16	7.77	7.47	6.97	6.80	6.45	6.65	6.57 / 10.10
31	9.63	9.56	8.01	7.73	7.22	6.89	6.78	6.38	6.40	6.47 / 9.36
32	9.48	9.44	7.98	7.57	7.08	6.88	6.77	6.37	6.52	6.42 / 8.68
33	9.80	9.72	8.03	7.59	7.20	6.91	6.79	6.39	6.63	6.50 / 8.98
34	9.51	9.45	7.99	7.60	7.07	6.90	6.78	6.33	6.45	6.41 / 8.90
35	9.61	9.54	8.02	7.69	7.06	6.84	6.69	6.34	6.52	6.43 / 8.81
36	10.00	9.89	8.10	7.72	7.41	6.94	6.77	6.31	6.61	6.53 / 9.27
37	9.86	9.78	8.01	7.53	7.22	6.90	6.76	6.29	6.60	6.50 / 9.06
38	10.26	10.14	8.18	7.71	7.46	6.99	6.68	6.31	6.61	6.57 / 8.73
39	10.10	10.00	8.08	7.57	7.40	7.01	6.76	6.29	6.61	6.54 / 9.45
40	10.73	10.63	8.43	7.75	7.59	7.03	6.78	6.26	6.61	6.68 / 9.32
41	10.22	10.12	8.14	7.61	7.33	6.95	6.69	6.29	6.45	6.58 / 9.50
42	10.78	10.66	8.36	7.71	7.43	7.09	6.92	6.40	6.62	6.67 / 10.00
43	11.46	11.32	8.61	7.84	7.61	7.19	6.78	6.33	6.62	6.78 / 9.15
44	12.83	12.46	9.04	8.02	7.67	7.39	6.86	6.40	6.58	6.95 / 9.53
45	12.33	12.03	8.78	7.96	7.63	7.28	6.83	6.44	6.61	6.86 / 9.67
46	12.57	12.26	8.86	8.01	7.64	7.33	6.82	6.44	6.60	6.90 / 9.62
47	12.64	12.30	8.89	7.98	7.62	7.32	6.82	6.46	6.56	6.91 / 9.32
48	11.30	11.07	8.65	7.68	7.54	7.13	6.81	6.44	6.54	6.76 / 9.47
49	11.34	11.13	8.46	7.68	7.52	6.96	6.74	6.38	6.52	6.80 / 9.00
S1	12.61	12.23	10.06	8.32	7.42	7.12	7.08	6.74	6.31	5.97 / 9.62
S2	12.90	12.19	10.01	8.27	7.40	7.13	7.05	6.75	6.27	6.09 / 9.50

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・ブライザー、BNPパリバ、JPモルガン、みずほ、UBS、メリル・ピッチ日本、大和SMBC、日興フィグループ

回号	Yield Curve Scenarios (%)									最低 / 最高 (%)
	-300bp	-200bp	-100bp	-50bp	0bp	50bp	100bp	200bp	300bp	
S3	12.36	12.36	9.60	8.24	7.42	7.15	7.06	6.73	6.25	6.08 / 9.55
S4	12.16	12.16	9.48	8.13	7.55	7.29	7.01	6.76	6.35	6.05 / 9.44
S5	12.55	12.55	9.14	8.06	7.59	7.20	7.02	6.76	6.35	6.05 / 9.46
S6	11.76	11.73	9.58	8.14	7.44	7.20	6.84	6.70	6.33	6.16 / 9.45
S7	11.73	11.72	9.59	8.13	7.62	7.40	6.85	6.71	6.33	6.13 / 9.46
S8	11.78	11.70	9.56	8.05	7.61	7.40	6.86	6.70	6.33	6.15 / 9.46
S9	11.80	11.67	9.53	8.04	7.59	7.40	6.87	6.70	6.32	5.96 / 9.41

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。