

PSJ 予測統計値  
(中央値)

2006年 7月 18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	12.22	12.13	8.05	7.56	7.25	6.93	6.84	6.68	6.27	5.22 / 8.85
2	11.97	11.88	8.06	7.51	7.18	6.92	6.86	6.64	6.18	5.26 / 8.80
3	12.26	12.19	8.09	7.53	7.18	6.93	6.84	6.65	6.15	5.40 / 8.83
4	11.76	11.65	8.14	7.36	7.20	6.91	6.84	6.59	6.08	5.39 / 8.57
5	12.14	11.50	8.30	7.40	7.10	6.92	6.85	6.44	6.05	5.52 / 8.28
6	11.98	11.64	8.24	7.49	7.17	6.94	6.87	6.51	6.07	5.55 / 8.36
7	11.83	11.57	8.14	7.48	7.05	6.92	6.85	6.51	6.16	5.72 / 9.19
8	11.55	11.38	8.14	7.52	7.08	6.95	6.88	6.54	6.18	5.70 / 8.87
9	11.23	10.90	8.14	7.53	7.11	6.96	6.89	6.43	6.02	5.62 / 8.16
10	11.11	10.79	8.10	7.51	7.05	6.98	6.91	6.50	6.22	5.76 / 8.57
11	10.94	10.14	8.02	7.47	7.07	7.00	6.93	6.47	6.23	5.70 / 8.27
12	11.00	10.67	7.98	7.33	7.10	7.00	6.90	6.53	6.26	5.83 / 9.08
13	10.98	10.11	8.00	7.48	7.09	7.01	6.89	6.42	6.22	5.81 / 9.34
14	11.03	10.25	8.02	7.44	7.04	6.97	6.89	6.42	6.21	5.83 / 8.72
15	11.00	10.12	8.00	7.41	7.05	6.98	6.88	6.44	6.23	5.85 / 8.84
16	10.86	9.98	7.94	7.38	7.06	6.98	6.86	6.44	6.21	5.90 / 9.12
17	10.94	10.03	7.99	7.39	7.08	7.01	6.87	6.42	6.24	5.87 / 8.90
18	11.11	10.27	8.07	7.31	7.07	7.00	6.86	6.41	6.23	5.81 / 9.02
19	11.03	10.14	8.06	7.36	7.08	7.01	6.85	6.42	6.25	5.81 / 9.02
20	11.55	10.59	8.12	7.38	7.15	7.08	6.87	6.48	6.30	5.93 / 8.72
21	11.54	10.54	8.09	7.51	7.15	7.06	6.87	6.53	6.35	6.07 / 9.16
22	11.83	10.83	8.14	7.46	7.15	7.06	6.87	6.53	6.35	6.07 / 8.83
23	11.88	10.86	8.12	7.55	7.16	7.03	6.85	6.56	6.37	6.06 / 9.19
24	11.76	10.70	8.03	7.60	7.32	7.06	6.86	6.58	6.41	6.08 / 8.78
25	11.42	10.37	8.04	7.58	7.23	7.02	6.81	6.57	6.43	6.08 / 8.57
26	11.00	9.97	7.94	7.43	7.13	6.98	6.77	6.50	6.32	6.06 / 8.95
27	10.54	9.75	7.86	7.52	7.18	6.89	6.68	6.55	6.47	6.09 / 8.53
28	10.87	9.94	7.91	7.53	7.21	6.95	6.73	6.56	6.42	6.07 / 8.59
29	10.56	9.80	7.82	7.49	7.13	6.86	6.64	6.55	6.49	6.15 / 9.06
30	10.44	9.68	7.81	7.47	7.12	6.84	6.64	6.55	6.52	6.27 / 9.83
31	10.35	9.61	7.77	7.46	7.09	6.83	6.65	6.58	6.48	6.17 / 9.18
32	10.23	9.50	7.68	7.36	7.03	6.77	6.64	6.56	6.49	6.10 / 8.50
33	10.42	9.65	7.75	7.42	7.08	6.81	6.63	6.55	6.51	6.17 / 8.75
34	10.33	9.54	7.63	7.31	7.01	6.84	6.61	6.53	6.49	6.14 / 8.68
35	10.38	9.64	7.67	7.35	7.02	6.84	6.64	6.55	6.49	6.16 / 8.57
36	10.67	9.90	7.82	7.45	7.13	6.87	6.67	6.55	6.47	6.28 / 9.00
37	10.62	9.85	7.82	7.44	7.14	6.87	6.69	6.53	6.46	6.30 / 8.87
38	10.84	9.98	7.83	7.41	7.13	6.86	6.65	6.54	6.46	6.27 / 8.52
39	10.71	9.86	7.80	7.40	7.13	6.87	6.67	6.52	6.45	6.35 / 9.23
40	11.13	10.15	7.90	7.43	7.14	6.87	6.65	6.52	6.45	6.35 / 9.06
41	10.92	10.09	7.79	7.38	7.12	6.90	6.67	6.51	6.44	6.39 / 9.25
42	11.30	10.50	7.96	7.45	7.19	6.93	6.72	6.52	6.43	6.47 / 9.73
43	11.70	10.61	8.04	7.49	7.20	6.98	6.74	6.53	6.44	6.45 / 8.85
44	12.73	11.23	8.16	7.60	7.26	6.99	6.81	6.55	6.44	6.51 / 9.05
S1	12.43	11.99	8.30	7.60	7.26	6.85	6.80	6.71	6.15	5.34 / 8.78
S2	12.62	12.02	8.36	7.62	7.25	6.86	6.81	6.65	6.11	5.34 / 8.65
S3	12.36	12.01	8.21	7.63	7.18	6.86	6.82	6.65	6.10	5.35 / 8.66
S4	12.23	11.85	8.12	7.65	7.18	6.90	6.89	6.68	6.14	5.45 / 8.68
S5	12.00	11.79	8.06	7.65	7.19	6.88	6.88	6.66	6.13	5.43 / 8.67
S6	12.15	11.59	8.61	7.73	7.18	6.93	6.93	6.59	6.13	5.44 / 8.60

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。