

PSJ 予測統計値
(平均値)

2006年 11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	13.18	12.48	9.50	8.26	7.55	7.13	6.79	6.34	5.94	5.73 / 9.13
2	13.19	12.45	9.47	8.22	7.53	7.13	6.77	6.31	5.92	5.76 / 9.02
3	13.29	12.59	9.52	8.27	7.57	7.15	6.79	6.35	5.96	5.85 / 9.14
4	12.65	11.93	8.98	8.00	7.39	7.02	6.78	6.33	5.91	5.92 / 8.72
5	12.50	11.78	8.89	7.91	7.35	6.99	6.78	6.32	5.90	6.02 / 8.41
6	12.58	11.82	8.90	7.94	7.41	7.01	6.78	6.33	5.92	6.09 / 8.45
7	12.65	11.87	8.94	7.97	7.44	7.08	6.81	6.40	5.99	6.19 / 9.29
8	12.60	11.84	8.88	7.94	7.41	7.05	6.80	6.38	5.97	6.22 / 8.98
9	12.22	11.44	8.66	7.82	7.29	6.94	6.72	6.28	5.90	6.14 / 8.31
10	12.17	11.36	8.65	7.83	7.34	7.03	6.78	6.38	5.96	6.16 / 8.55
11	12.06	11.21	8.49	7.76	7.26	6.95	6.73	6.30	5.92	5.88 / 8.20
12	12.12	11.29	8.46	7.78	7.34	7.02	6.84	6.42	6.00	6.32 / 9.05
13	12.24	11.44	8.63	7.89	7.40	7.06	6.87	6.44	6.05	5.85 / 9.27
14	12.23	11.39	8.55	7.79	7.32	6.99	6.75	6.34	5.95	6.04 / 8.67
15	12.19	11.34	8.53	7.79	7.33	7.00	6.76	6.38	5.94	5.97 / 8.82
16	12.19	11.31	8.51	7.81	7.35	7.03	6.78	6.37	5.98	5.97 / 9.10
17	12.10	11.25	8.49	7.75	7.32	6.99	6.78	6.36	5.96	5.91 / 8.90
18	12.12	11.22	8.45	7.76	7.32	6.99	6.78	6.39	5.96	5.85 / 8.95
19	12.06	11.19	8.46	7.75	7.31	6.98	6.78	6.38	5.98	5.84 / 8.95
20	12.33	11.45	8.54	7.78	7.33	7.02	6.79	6.40	5.98	6.44 / 8.65
21	12.39	11.47	8.53	7.81	7.39	7.10	6.85	6.45	6.03	6.59 / 9.11
22	12.49	11.57	8.58	7.84	7.39	7.06	6.82	6.44	6.00	6.61 / 8.80
23	12.69	11.77	8.67	7.87	7.43	7.09	6.86	6.45	6.03	6.63 / 8.79
24	12.72	11.81	8.77	7.92	7.43	7.12	6.86	6.47	6.02	6.61 / 8.69
25	12.52	11.57	8.56	7.79	7.38	7.06	6.86	6.43	6.01	6.63 / 8.47
26	12.17	11.19	8.40	7.73	7.31	7.05	6.82	6.40	5.98	6.60 / 8.86
27	11.95	11.01	8.29	7.66	7.31	7.04	6.81	6.44	6.01	6.44 / 8.53
28	12.27	11.26	8.40	7.73	7.32	7.02	6.80	6.40	5.98	6.52 / 8.52
29	11.95	10.93	8.29	7.72	7.36	7.09	6.87	6.48	6.05	6.39 / 9.06
30	11.97	10.92	8.34	7.80	7.44	7.17	6.97	6.55	6.14	6.37 / 9.77
31	11.69	10.66	8.18	7.64	7.29	7.06	6.85	6.48	6.02	6.32 / 9.12
32	11.40	10.31	8.03	7.55	7.20	6.98	6.80	6.42	5.95	6.28 / 8.63
33	11.78	10.71	8.18	7.62	7.27	7.02	6.84	6.44	6.01	6.35 / 8.74
34	11.58	10.46	8.09	7.58	7.20	7.01	6.82	6.41	5.97	6.28 / 8.68
35	11.66	10.55	8.11	7.58	7.21	6.97	6.80	6.42	5.95	6.31 / 8.68
36	11.97	10.90	8.21	7.70	7.34	7.03	6.85	6.44	6.02	6.37 / 8.94
37	11.96	10.86	8.25	7.65	7.28	7.02	6.82	6.45	5.99	6.36 / 8.80
38	12.26	11.19	8.35	7.70	7.34	7.04	6.82	6.42	5.97	6.42 / 8.69
39	12.26	11.14	8.32	7.72	7.37	7.08	6.89	6.49	6.05	6.40 / 9.17
40	12.82	11.70	8.58	7.86	7.46	7.15	6.90	6.49	6.06	6.49 / 9.03
41	12.42	11.26	8.41	7.75	7.36	7.08	6.88	6.48	6.03	6.42 / 9.24
42	13.09	11.92	8.79	8.01	7.53	7.24	6.97	6.57	6.12	6.49 / 9.72
43	13.38	12.22	8.92	8.03	7.51	7.20	6.93	6.51	6.04	6.57 / 8.81
44	14.11	12.95	9.27	8.21	7.63	7.32	6.99	6.56	6.08	6.71 / 9.11
45	13.92	12.71	9.14	8.16	7.63	7.30	6.99	6.57	6.09	6.65 / 9.33
46	14.07	12.86	9.14	8.15	7.63	7.31	7.00	6.56	6.12	6.70 / 9.22
47	14.12	12.86	9.07	8.11	7.63	7.30	6.98	6.54	6.10	6.72 / 8.97
48	13.48	12.17	8.75	7.97	7.52	7.22	6.96	6.53	6.10	6.56 / 9.15
S1	13.21	12.40	9.57	8.35	7.64	7.25	6.90	6.41	6.03	5.78 / 9.14
S2	13.19	12.40	9.51	8.31	7.57	7.17	6.83	6.34	5.97	5.87 / 9.02
S3	13.15	12.39	9.48	8.25	7.57	7.13	6.80	6.32	5.95	5.84 / 8.98

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・ブザース、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	
S4	13.03	12.24	9.33	8.20	7.54	7.13	6.80	6.35	5.97	5.85 / 8.98
S5	13.03	12.24	9.29	8.17	7.53	7.11	6.82	6.37	5.95	5.86 / 9.00
S6	12.89	12.08	9.29	8.16	7.46	7.06	6.79	6.35	5.95	5.96 / 8.98
S7	12.88	12.11	9.30	8.17	7.51	7.11	6.79	6.37	5.96	5.94 / 8.99
S8	12.91	12.14	9.29	8.17	7.53	7.12	6.81	6.38	5.99	5.95 / 9.28
S9	12.78	11.99	9.18	8.09	7.47	7.07	6.77	6.35	5.96	5.77 / 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。