

PSJ 予測統計値  
(中央値)

2006年 9月 1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	12.15	12.15	8.90	7.83	7.27	6.96	6.85	6.66	6.20	5.70 /	9.08
2	11.90	11.90	8.80	7.83	7.21	7.00	6.85	6.64	6.18	5.71 /	9.03
3	12.20	12.20	8.87	7.85	7.26	7.00	6.84	6.66	6.20	5.85 /	9.07
4	11.75	11.75	8.51	7.59	7.25	6.91	6.84	6.62	6.10	5.80 /	8.71
5	12.10	11.98	8.44	7.59	7.19	6.87	6.80	6.44	6.06	5.88 /	8.57
6	11.95	11.95	8.52	7.71	7.26	6.92	6.86	6.54	6.09	5.97 /	8.60
7	11.80	11.80	8.48	7.62	7.20	6.92	6.84	6.59	6.16	5.99 /	9.32
8	11.52	11.49	8.45	7.66	7.23	6.93	6.85	6.61	6.17	6.07 /	8.96
9	11.23	11.08	8.38	7.68	7.20	6.95	6.88	6.49	6.08	5.99 /	8.46
10	11.15	11.00	8.31	7.61	7.16	6.97	6.89	6.58	6.21	6.06 /	8.66
11	11.10	10.83	8.27	7.68	7.12	6.98	6.91	6.54	6.21	6.01 /	8.33
12	10.92	10.87	8.19	7.59	7.08	7.00	6.94	6.51	6.24	5.85 /	9.14
13	10.86	10.75	8.27	7.61	7.10	7.00	6.91	6.48	6.21	5.96 /	9.41
14	10.92	10.80	8.26	7.65	7.09	6.95	6.88	6.48	6.19	6.00 /	8.81
15	10.89	10.78	8.27	7.64	7.07	6.99	6.91	6.48	6.22	6.01 /	8.96
16	10.85	10.71	8.25	7.65	7.07	6.98	6.90	6.46	6.21	5.97 /	9.19
17	10.79	10.71	8.27	7.55	7.06	6.99	6.90	6.47	6.23	5.97 /	8.97
18	10.78	10.72	8.25	7.58	7.07	7.00	6.90	6.46	6.23	6.00 /	9.09
19	10.77	10.68	8.25	7.54	7.07	6.99	6.92	6.46	6.23	6.00 /	9.09
20	11.59	11.28	8.37	7.65	7.12	7.00	6.92	6.48	6.29	5.97 /	8.79
21	11.55	11.21	8.35	7.57	7.13	7.02	6.91	6.51	6.36	5.99 /	9.25
22	11.87	11.41	8.46	7.61	7.15	7.02	6.92	6.50	6.35	6.10 /	8.90
23	11.90	11.44	8.51	7.64	7.27	7.02	6.92	6.51	6.38	6.16 /	9.34
24	11.78	11.37	8.45	7.61	7.32	7.10	6.90	6.53	6.40	6.14 /	8.85
25	11.43	11.08	8.36	7.61	7.30	7.04	6.87	6.54	6.41	6.09 /	8.63
26	11.06	10.72	8.11	7.47	7.18	7.00	6.82	6.51	6.33	5.79 /	9.00
27	10.27	10.19	7.95	7.45	7.14	6.95	6.74	6.49	6.38	5.89 /	8.60
28	10.88	10.48	8.09	7.52	7.21	7.02	6.76	6.51	6.42	5.92 /	8.62
29	10.18	10.10	7.91	7.39	7.09	6.93	6.69	6.48	6.38	5.84 /	9.08
30	10.17	10.19	7.94	7.38	7.05	6.88	6.63	6.41	6.36	5.85 /	9.85
31	10.00	9.93	7.82	7.33	7.01	6.86	6.63	6.45	6.34	5.75 /	9.19
32	9.81	9.74	7.80	7.27	7.06	6.88	6.62	6.52	6.46	5.62 /	8.53
33	10.13	10.05	7.91	7.35	7.05	6.96	6.67	6.53	6.35	5.80 /	8.82
34	9.78	9.71	7.76	7.22	7.04	6.90	6.62	6.52	6.40	5.60 /	8.68
35	9.90	9.83	7.77	7.24	7.01	6.92	6.61	6.49	6.43	5.65 /	8.58
36	10.27	10.16	7.93	7.39	7.09	6.95	6.66	6.49	6.40	5.86 /	9.02
37	10.15	10.07	7.86	7.36	7.02	6.97	6.65	6.52	6.46	5.78 /	8.89
38	10.48	10.36	8.02	7.45	7.15	7.01	6.70	6.52	6.42	5.95 /	8.58
39	10.33	10.23	7.97	7.37	7.12	6.95	6.68	6.51	6.46	5.87 /	9.29
40	10.85	10.70	8.13	7.55	7.23	7.04	6.73	6.53	6.48	6.18 /	9.17
41	10.43	10.31	7.98	7.47	7.13	6.98	6.68	6.53	6.46	5.93 /	9.36
42	10.96	10.67	8.10	7.49	7.11	6.96	6.77	6.53	6.42	6.17 /	9.89
43	11.63	11.00	8.25	7.60	7.19	6.98	6.80	6.56	6.38	6.43 /	9.02
44	12.92	12.00	8.58	7.81	7.44	7.11	6.85	6.57	6.47	6.77 /	9.35
45	12.53	11.66	8.48	7.73	7.39	7.12	6.83	6.56	6.46	6.64 /	9.54
46	12.76	11.76	8.44	7.71	7.34	7.12	6.85	6.53	6.43	6.67 /	9.48
S1	13.08	12.33	9.27	7.92	7.37	6.96	6.84	6.75	6.21	5.74 /	9.14
S2	12.81	12.49	8.98	7.94	7.36	6.97	6.85	6.66	6.14	5.79 /	8.96
S3	12.47	12.34	8.98	7.88	7.37	6.98	6.87	6.68	6.14	5.80 /	8.98
S4	12.37	12.22	8.78	7.78	7.37	7.01	6.90	6.71	6.21	5.80 /	8.99
S5	12.02	12.00	8.77	7.66	7.25	6.98	6.81	6.66	6.21	5.79 /	9.01

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、メリル・リンチ日本、大和SMBC、日興シティグループ

回号	Yield Curve Scenarios ( % )									最低 / 最高 ( % )
	-300bp	-200bp	-100bp	-50bp	0bp	50bp	100bp	200bp	300bp	
S6	12.26	12.12	8.76	7.76	7.31	7.01	6.82	6.66	6.17	5.86 / 8.92
S7	12.19	12.12	8.75	7.77	7.45	7.01	6.91	6.72	6.17	5.84 / 8.92

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。