

PSJ 予測統計値
(中央値)

2006年 10月 2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・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	12.18	12.18	9.11	7.83	7.59	6.99	6.95	6.66	6.31	5.81 /	9.06
2	12.33	12.33	9.06	7.89	7.54	7.04	6.90	6.59	6.29	5.83 /	9.11
3	12.55	12.55	9.10	7.89	7.63	7.03	6.89	6.59	6.29	5.92 /	9.17
4	11.69	11.69	8.60	7.97	7.37	7.01	6.79	6.57	6.13	5.93 /	8.67
5	11.48	11.47	8.92	7.66	7.32	6.91	6.77	6.41	6.12	6.02 /	8.56
6	11.69	11.65	8.66	7.88	7.33	7.00	6.81	6.51	6.13	6.09 /	8.55
7	11.87	11.87	8.51	7.81	7.46	7.04	6.82	6.62	6.25	6.19 /	9.27
8	11.84	11.79	8.53	7.83	7.29	6.96	6.82	6.64	6.24	6.22 /	8.90
9	11.67	11.64	8.49	7.88	7.26	6.99	6.84	6.47	6.09	6.13 /	8.44
10	11.70	11.60	8.44	7.93	7.25	7.02	6.86	6.55	6.28	6.22 /	8.60
11	11.46	11.35	8.38	7.90	7.14	7.01	6.87	6.56	6.27	5.95 /	8.27
12	11.15	10.95	8.22	7.80	7.31	7.03	6.96	6.58	6.29	6.31 /	9.10
13	11.34	11.18	8.38	7.95	7.32	7.03	6.97	6.50	6.23	5.92 /	9.33
14	11.41	11.25	8.41	7.97	7.29	6.94	6.85	6.49	6.20	6.12 /	8.72
15	11.40	11.17	8.35	7.94	7.25	6.97	6.82	6.52	6.24	6.05 /	8.88
16	11.31	11.09	8.34	7.90	7.31	7.04	6.96	6.50	6.23	6.04 /	9.16
17	11.32	11.09	8.38	7.81	7.31	7.01	6.91	6.52	6.25	5.98 /	8.89
18	11.28	11.05	8.33	7.81	7.32	7.04	6.95	6.51	6.23	5.92 /	9.00
19	11.24	10.96	8.31	7.77	7.30	7.01	6.95	6.54	6.26	5.92 /	9.01
20	11.91	11.45	8.45	7.72	7.22	7.02	6.90	6.60	6.31	6.40 /	8.71
21	11.88	11.36	8.50	7.62	7.33	7.08	6.92	6.70	6.41	6.54 /	9.17
22	12.19	11.47	8.58	7.72	7.24	7.09	6.87	6.68	6.38	6.57 /	8.86
23	12.22	11.48	8.60	7.85	7.26	7.10	6.88	6.72	6.43	6.55 /	8.79
24	11.97	11.37	8.59	7.75	7.39	7.10	6.85	6.73	6.47	6.56 /	8.76
25	11.50	11.03	8.47	7.66	7.38	7.09	6.83	6.67	6.50	6.58 /	8.55
26	11.24	10.79	8.25	7.68	7.19	6.98	6.84	6.61	6.33	6.54 /	8.93
27	10.35	10.14	8.14	7.50	7.35	6.94	6.78	6.68	6.58	6.44 /	8.58
28	10.88	10.53	8.24	7.49	7.37	6.87	6.75	6.67	6.47	6.53 /	8.61
29	10.22	10.02	8.07	7.63	7.44	7.01	6.75	6.65	6.58	6.36 /	9.08
30	10.21	10.04	8.07	7.58	7.46	6.98	6.76	6.51	6.61	6.37 /	9.86
31	10.01	9.82	7.96	7.35	7.31	6.89	6.74	6.64	6.39	6.32 /	9.20
32	9.82	9.65	7.87	7.43	7.09	6.83	6.74	6.66	6.53	6.28 /	8.55
33	10.19	9.99	8.02	7.37	7.19	6.94	6.75	6.64	6.60	6.35 /	8.83
34	9.85	9.68	7.82	7.31	7.05	6.91	6.71	6.65	6.46	6.28 /	8.76
35	9.93	9.76	7.87	7.26	7.03	6.85	6.67	6.63	6.53	6.29 /	8.59
36	10.37	10.15	8.02	7.57	7.39	6.96	6.73	6.63	6.57	6.37 /	9.02
37	10.28	10.02	7.97	7.35	7.32	6.91	6.72	6.64	6.57	6.35 /	8.88
38	10.65	10.38	8.12	7.42	7.46	7.00	6.69	6.65	6.59	6.42 /	8.55
39	10.50	10.26	8.03	7.52	7.40	6.98	6.74	6.66	6.57	6.39 /	9.28
40	11.15	10.81	8.29	7.68	7.51	7.10	6.74	6.65	6.53	6.48 /	9.12
41	10.61	10.32	8.05	7.38	7.32	6.96	6.62	6.45	6.45	6.39 /	9.35
42	11.19	10.75	8.25	7.62	7.41	7.11	6.87	6.65	6.55	6.48 /	9.82
43	11.88	11.09	8.42	7.63	7.55	7.21	6.80	6.65	6.55	6.57 /	8.95
44	12.88	12.17	8.69	7.83	7.62	7.39	6.93	6.59	6.56	6.71 /	9.25
45	12.57	11.74	8.63	7.71	7.59	7.29	6.85	6.64	6.55	6.65 /	9.46
46	12.73	11.88	8.61	7.73	7.58	7.32	6.81	6.64	6.55	6.69 /	9.33
47	12.91	12.01	8.61	7.70	7.54	7.28	6.89	6.56	6.56	6.76 /	9.07
S1	12.69	12.15	10.00	7.83	7.42	7.00	6.97	6.71	6.23	5.85 /	9.13
S2	12.90	12.15	10.01	8.11	7.41	7.02	7.01	6.58	6.24	5.91 /	9.11
S3	12.44	12.33	9.27	7.89	7.51	7.05	7.02	6.55	6.25	5.91 /	9.11
S4	12.18	12.05	9.14	7.84	7.56	7.18	7.00	6.74	6.22	5.90 /	8.95

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、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	12.40	12.40	8.78	7.84	7.59	7.21	6.99	6.76	6.20	5.91 / 8.95
S6	11.76	11.61	9.54	7.93	7.41	7.22	6.82	6.68	6.16	5.99 / 8.89
S7	11.76	11.61	9.54	7.95	7.60	7.27	6.82	6.68	6.17	5.96 / 8.90
S8	11.78	11.49	9.41	7.91	7.62	7.26	6.85	6.55	6.15	5.98 / 8.74

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。