

PSJ 予測統計値
(平均値)

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・ブザーク,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	13.18	12.21	8.85	7.85	7.32	6.99	6.76	6.42	6.13	5.22 / 8.85
2	13.15	12.17	8.80	7.83	7.31	6.98	6.74	6.41	6.13	5.26 / 8.80
3	13.24	12.23	8.82	7.83	7.31	6.97	6.74	6.41	6.13	5.40 / 8.83
4	12.68	11.62	8.47	7.66	7.23	6.93	6.72	6.39	6.09	5.39 / 8.57
5	12.56	11.48	8.42	7.62	7.20	6.92	6.70	6.37	6.07	5.52 / 8.28
6	12.63	11.56	8.43	7.64	7.22	6.94	6.73	6.40	6.10	5.55 / 8.36
7	12.63	11.52	8.41	7.66	7.26	6.98	6.77	6.43	6.14	5.72 / 9.19
8	12.61	11.47	8.37	7.63	7.23	6.95	6.75	6.41	6.12	5.70 / 8.87
9	12.22	11.04	8.19	7.52	7.14	6.88	6.68	6.36	6.03	5.62 / 8.16
10	12.12	10.92	8.16	7.54	7.18	6.92	6.72	6.41	6.12	5.76 / 8.57
11	11.97	10.71	8.04	7.47	7.11	6.85	6.66	6.35	6.07	5.70 / 8.27
12	12.15	10.86	8.05	7.52	7.19	6.95	6.76	6.45	6.16	5.83 / 9.08
13	12.17	10.88	8.11	7.54	7.20	6.95	6.76	6.45	6.16	5.81 / 9.34
14	12.18	10.96	8.09	7.50	7.15	6.90	6.71	6.40	6.12	5.83 / 8.72
15	12.18	10.91	8.08	7.50	7.15	6.91	6.72	6.40	6.12	5.85 / 8.84
16	12.16	10.86	8.07	7.51	7.17	6.92	6.73	6.42	6.14	5.90 / 9.12
17	12.11	10.82	8.05	7.49	7.15	6.91	6.72	6.41	6.13	5.87 / 8.90
18	12.10	10.80	8.04	7.48	7.14	6.90	6.72	6.41	6.13	5.81 / 9.02
19	12.10	10.79	8.05	7.49	7.16	6.92	6.74	6.43	6.15	5.81 / 9.02
20	12.45	11.13	8.16	7.55	7.21	6.97	6.78	6.46	6.17	5.93 / 8.72
21	12.48	11.11	8.15	7.59	7.26	7.01	6.82	6.50	6.21	6.07 / 9.16
22	12.57	11.21	8.14	7.58	7.24	6.99	6.80	6.48	6.19	6.07 / 8.83
23	12.87	11.49	8.26	7.63	7.29	7.04	6.85	6.52	6.23	6.06 / 9.19
24	12.86	11.47	8.33	7.66	7.29	7.05	6.85	6.52	6.23	6.08 / 8.78
25	12.67	11.26	8.17	7.58	7.27	7.03	6.83	6.52	6.23	6.08 / 8.57
26	12.27	10.80	8.05	7.51	7.21	6.98	6.79	6.47	6.18	6.06 / 8.95
27	12.07	10.61	7.93	7.45	7.18	6.96	6.79	6.48	6.19	6.09 / 8.53
28	12.43	10.94	8.05	7.51	7.21	6.98	6.79	6.48	6.19	6.07 / 8.59
29	12.03	10.51	7.95	7.49	7.22	7.00	6.82	6.52	6.23	6.15 / 9.06
30	11.99	10.39	7.98	7.55	7.28	7.06	6.88	6.58	6.29	6.27 / 9.83
31	11.80	10.22	7.88	7.48	7.21	7.00	6.83	6.52	6.23	6.17 / 9.18
32	11.49	9.90	7.76	7.38	7.13	6.93	6.76	6.46	6.17	6.10 / 8.50
33	11.90	10.29	7.86	7.45	7.19	6.97	6.80	6.50	6.21	6.17 / 8.75
34	11.73	10.06	7.83	7.40	7.16	6.95	6.78	6.47	6.19	6.14 / 8.68
35	11.85	10.17	7.84	7.41	7.16	6.95	6.78	6.47	6.19	6.16 / 8.57
36	12.14	10.54	7.93	7.50	7.22	7.00	6.83	6.52	6.23	6.28 / 9.00
37	12.20	10.52	7.99	7.50	7.23	7.01	6.83	6.52	6.23	6.30 / 8.87
38	12.46	10.84	8.02	7.49	7.20	6.99	6.80	6.50	6.21	6.27 / 8.52
39	12.44	10.68	8.01	7.52	7.25	7.03	6.85	6.55	6.25	6.35 / 9.23
40	12.97	11.29	8.17	7.58	7.28	7.05	6.86	6.54	6.25	6.35 / 9.06
41	12.70	10.94	8.12	7.58	7.29	7.06	6.88	6.56	6.27	6.39 / 9.25
42	13.27	11.50	8.45	7.76	7.37	7.14	6.95	6.62	6.32	6.47 / 9.73
43	13.61	11.90	8.49	7.74	7.33	7.09	6.89	6.56	6.27	6.45 / 8.85
44	14.23	12.54	8.68	7.85	7.41	7.14	6.94	6.60	6.31	6.51 / 9.05
S1	13.04	12.01	8.82	7.83	7.29	6.97	6.74	6.40	6.12	5.34 / 8.78
S2	13.11	12.05	8.87	7.85	7.31	6.99	6.76	6.42	6.13	5.34 / 8.65
S3	13.06	12.03	8.77	7.78	7.26	6.93	6.70	6.37	6.09	5.35 / 8.66
S4	12.95	11.88	8.68	7.75	7.26	6.95	6.72	6.39	6.11	5.45 / 8.68
S5	12.88	11.81	8.63	7.71	7.23	6.92	6.70	6.37	6.09	5.43 / 8.67
S6	12.79	11.77	8.69	7.73	7.21	6.91	6.69	6.37	6.09	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。