

PSJ 予測統計値  
(中央値)

2006年 8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,メリル・ピッチ日本,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	13.10	12.31	8.16	7.51	7.22	6.85	6.79	6.50	6.08	5.19 /	8.62
2	13.16	12.31	8.17	7.43	7.15	6.85	6.71	6.43	6.06	5.23 /	8.59
3	13.31	12.43	8.19	7.45	7.18	6.86	6.69	6.43	6.04	5.38 /	8.62
4	12.58	11.88	8.16	7.33	7.07	6.78	6.69	6.40	5.97	5.40 /	8.40
5	12.92	12.00	8.18	7.36	7.11	6.79	6.70	6.27	5.97	5.51 /	8.26
6	12.77	12.00	8.19	7.42	7.10	6.79	6.68	6.33	5.98	5.57 /	8.25
7	12.59	11.81	8.16	7.41	7.09	6.81	6.70	6.30	6.01	5.73 /	9.02
8	12.59	11.48	8.17	7.47	7.12	6.83	6.74	6.30	6.01	5.72 /	8.69
9	12.52	11.34	8.10	7.50	7.18	6.88	6.79	6.32	5.91	5.63 /	8.13
10	12.47	11.18	8.00	7.45	7.18	6.90	6.80	6.34	6.07	5.78 /	8.42
11	12.03	10.90	7.98	7.41	7.16	6.92	6.82	6.32	6.07	5.72 /	8.13
12	11.63	10.75	7.93	7.43	7.14	6.95	6.77	6.41	6.17	5.86 /	8.92
13	11.90	10.68	8.00	7.41	7.17	6.98	6.80	6.36	6.17	5.73 /	9.18
14	11.96	10.79	8.00	7.46	7.13	6.91	6.78	6.30	6.08	5.81 /	8.58
15	11.92	10.70	7.97	7.40	7.16	6.95	6.79	6.35	6.14	5.84 /	8.69
16	11.86	10.62	7.96	7.40	7.17	6.97	6.82	6.43	6.21	5.84 /	8.96
17	11.83	10.63	7.99	7.40	7.15	6.95	6.78	6.34	6.15	5.79 /	8.75
18	11.69	10.48	7.99	7.39	7.16	6.98	6.80	6.38	6.19	5.74 /	8.86
19	11.68	10.44	8.00	7.41	7.15	6.96	6.76	6.36	6.17	5.73 /	8.87
20	12.49	10.53	8.02	7.42	7.19	6.98	6.79	6.45	6.31	5.96 /	8.58
21	12.35	10.46	8.01	7.46	7.20	6.97	6.75	6.52	6.39	6.12 /	8.99
22	12.55	10.66	8.06	7.47	7.24	6.98	6.78	6.51	6.39	6.11 /	8.67
23	12.54	10.66	8.08	7.60	7.27	6.97	6.77	6.53	6.43	6.11 /	9.02
24	12.40	10.59	8.06	7.78	7.41	6.98	6.75	6.53	6.46	6.11 /	8.61
25	12.07	10.44	8.00	7.76	7.36	6.95	6.72	6.54	6.46	6.13 /	8.41
26	11.88	10.05	7.94	7.54	7.11	6.90	6.67	6.52	6.37	6.09 /	8.81
27	11.28	9.87	7.88	7.69	7.23	6.80	6.61	6.51	6.48	6.14 /	8.39
28	11.66	10.07	7.90	7.72	7.27	6.84	6.62	6.51	6.46	6.12 /	8.43
29	11.17	9.77	7.87	7.64	7.17	6.76	6.60	6.51	6.48	6.21 /	8.93
30	11.11	9.76	7.90	7.60	7.17	6.74	6.60	6.52	6.49	6.24 /	9.70
31	10.94	9.59	7.84	7.54	7.08	6.71	6.59	6.50	6.48	6.19 /	9.05
32	10.74	9.43	7.82	7.49	7.01	6.70	6.60	6.53	6.50	6.16 /	8.41
33	11.05	9.68	7.90	7.55	7.11	6.72	6.59	6.51	6.48	6.22 /	8.63
34	10.70	9.38	7.81	7.47	6.98	6.75	6.59	6.52	6.49	6.18 /	8.56
35	10.86	9.48	7.82	7.48	7.00	6.72	6.60	6.53	6.49	6.21 /	8.45
36	11.25	9.80	7.89	7.58	7.17	6.74	6.60	6.52	6.48	6.27 /	8.86
37	11.15	9.70	7.86	7.53	7.12	6.73	6.59	6.52	6.48	6.26 /	8.74
38	11.54	9.98	7.94	7.61	7.25	6.78	6.61	6.53	6.48	6.30 /	8.67
39	11.33	9.82	7.89	7.55	7.18	6.74	6.60	6.52	6.46	6.30 /	9.10
40	11.83	10.29	7.93	7.67	7.31	6.81	6.62	6.52	6.47	6.37 /	9.13
41	11.44	9.90	7.92	7.56	7.22	6.78	6.62	6.53	6.46	6.32 /	9.12
42	11.87	10.30	7.99	7.67	7.32	6.89	6.64	6.54	6.45	6.41 /	9.59
43	12.32	10.72	8.08	7.75	7.40	6.95	6.68	6.54	6.45	6.46 /	9.73
44	13.16	11.27	8.23	7.80	7.54	7.03	6.77	6.57	6.47	6.57 /	10.37
45	12.72	10.90	8.17	7.84	7.46	6.99	6.71	6.50	6.40	6.48 /	10.17
S1	13.33	12.47	8.55	7.55	7.11	6.79	6.64	6.34	5.98	5.31 /	8.56
S2	13.47	12.54	8.67	7.56	7.13	6.81	6.64	6.33	5.95	5.32 /	8.44
S3	13.24	12.38	8.33	7.59	7.09	6.81	6.61	6.26	5.93	5.33 /	8.45
S4	13.03	12.27	8.22	7.62	7.16	6.77	6.59	6.34	5.99	5.34 /	8.52
S5	12.91	12.05	8.26	7.60	7.12	6.77	6.59	6.30	6.00	5.41 /	8.50
S6	13.06	12.13	8.45	7.69	7.11	6.74	6.62	6.39	6.00	5.44 /	8.43

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、メリリヤ日本、大和SMBC、日興シイグループ

回号	Yield Curve Scenarios ( % )									最低 / 最高 ( % )
	-300bp	-200bp	-100bp	-50bp	0bp	50bp	100bp	200bp	300bp	
S7	13.07	12.13	8.45	7.68	7.13	6.73	6.60	6.37	6.00	5.41 / 8.45

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。