

PSJ 予測統計値  
(平均値)

2006年 10月 16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	13.20	12.45	9.38	8.21	7.54	7.12	6.79	6.35	5.99	5.65	/	8.87
2	13.20	12.43	9.35	8.16	7.51	7.12	6.77	6.32	5.97	5.66	/	8.91
3	13.30	12.56	9.39	8.20	7.54	7.14	6.78	6.36	6.01	5.75	/	8.97
4	12.64	11.86	8.88	7.95	7.37	7.01	6.75	6.33	5.95	5.79	/	8.54
5	12.48	11.70	8.78	7.85	7.32	6.95	6.75	6.30	5.93	5.90	/	8.42
6	12.57	11.75	8.81	7.89	7.38	6.98	6.76	6.33	5.97	5.97	/	8.42
7	12.64	11.80	8.85	7.93	7.41	7.05	6.79	6.40	6.03	6.07	/	9.09
8	12.60	11.77	8.78	7.88	7.38	7.02	6.77	6.37	6.01	6.11	/	8.71
9	12.22	11.35	8.59	7.78	7.27	6.93	6.71	6.27	5.95	6.03	/	8.31
10	12.16	11.27	8.59	7.80	7.32	7.02	6.76	6.37	6.01	6.11	/	8.45
11	12.05	11.10	8.43	7.73	7.25	6.94	6.72	6.30	5.98	5.85	/	8.11
12	12.12	11.17	8.40	7.75	7.32	7.00	6.83	6.41	6.05	6.25	/	8.94
13	12.20	11.25	8.50	7.80	7.34	7.00	6.81	6.39	6.07	5.82	/	9.16
14	12.20	11.27	8.48	7.75	7.29	6.98	6.74	6.33	6.01	6.01	/	8.55
15	12.18	11.23	8.46	7.76	7.31	6.99	6.75	6.38	6.00	5.95	/	8.71
16	12.18	11.20	8.45	7.77	7.33	7.01	6.77	6.37	6.04	5.95	/	8.99
17	12.09	11.14	8.42	7.71	7.30	6.98	6.76	6.35	6.02	5.89	/	8.72
18	12.11	11.10	8.39	7.73	7.30	6.98	6.76	6.38	6.03	5.83	/	8.85
19	12.05	11.07	8.40	7.72	7.28	6.97	6.76	6.36	6.04	5.82	/	8.85
20	12.34	11.33	8.47	7.74	7.31	7.00	6.78	6.39	6.05	6.33	/	8.56
21	12.40	11.34	8.46	7.78	7.38	7.09	6.84	6.45	6.10	6.48	/	9.02
22	12.50	11.46	8.50	7.81	7.38	7.05	6.80	6.43	6.07	6.51	/	8.71
23	12.69	11.65	8.58	7.83	7.41	7.08	6.84	6.44	6.09	6.49	/	8.63
24	12.73	11.69	8.68	7.88	7.41	7.12	6.85	6.47	6.09	6.51	/	8.60
25	12.53	11.46	8.48	7.76	7.36	7.06	6.85	6.42	6.09	6.52	/	8.40
26	12.16	11.05	8.33	7.69	7.30	7.02	6.81	6.40	6.05	6.49	/	8.79
27	11.97	10.89	8.23	7.64	7.30	7.03	6.80	6.44	6.10	6.36	/	8.47
28	12.28	11.13	8.33	7.70	7.31	7.00	6.78	6.40	6.06	6.44	/	8.47
29	11.95	10.78	8.22	7.68	7.34	7.05	6.84	6.46	6.12	6.32	/	8.97
30	11.97	10.79	8.30	7.78	7.43	7.15	6.95	6.48	6.22	6.31	/	9.75
31	11.70	10.52	8.13	7.62	7.29	7.04	6.84	6.48	6.10	6.26	/	9.10
32	11.39	10.18	7.99	7.54	7.18	6.96	6.78	6.41	6.04	6.22	/	8.49
33	11.79	10.59	8.14	7.62	7.27	7.01	6.83	6.44	6.10	6.29	/	8.73
34	11.57	10.31	8.05	7.56	7.19	6.99	6.80	6.40	6.05	6.23	/	8.66
35	11.65	10.39	8.05	7.54	7.19	6.94	6.77	6.40	6.03	6.24	/	8.52
36	11.98	10.76	8.16	7.68	7.32	7.02	6.84	6.44	6.11	6.31	/	8.92
37	11.96	10.72	8.20	7.62	7.27	7.01	6.80	6.45	6.09	6.30	/	8.79
38	12.28	11.06	8.28	7.67	7.32	7.02	6.80	6.40	6.06	6.36	/	8.55
39	12.26	10.99	8.26	7.70	7.36	7.06	6.87	6.48	6.15	6.35	/	9.16
40	12.84	11.57	8.50	7.82	7.44	7.13	6.89	6.48	6.15	6.43	/	8.99
41	12.46	11.13	8.34	7.71	7.34	7.06	6.86	6.46	6.12	6.34	/	9.23
42	13.11	11.77	8.71	7.97	7.51	7.23	6.96	6.56	6.22	6.44	/	9.69
43	13.41	12.08	8.80	7.98	7.48	7.19	6.92	6.49	6.15	6.51	/	8.78
44	14.13	12.82	9.10	8.14	7.60	7.30	6.98	6.55	6.18	6.64	/	9.02
45	13.95	12.57	8.99	8.10	7.61	7.29	6.99	6.55	6.20	6.58	/	9.26
46	14.04	12.67	8.97	8.07	7.59	7.28	6.98	6.53	6.22	6.62	/	9.11
47	14.12	12.68	8.90	8.04	7.59	7.27	6.97	6.52	6.22	6.67	/	8.84
S1	13.20	12.34	9.44	8.28	7.61	7.22	6.88	6.41	6.07	5.68	/	8.93
S2	13.19	12.36	9.38	8.23	7.54	7.14	6.80	6.33	5.99	5.73	/	8.91
S3	13.14	12.33	9.34	8.19	7.53	7.10	6.77	6.32	5.98	5.73	/	8.91
S4	13.03	12.17	9.21	8.14	7.51	7.11	6.79	6.35	6.01	5.75	/	8.74

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		
S5	13.01	12.17	9.17	8.10	7.49	7.09	6.79	6.36	5.99	5.75	8.74
S6	12.86	12.00	9.16	8.09	7.42	7.04	6.77	6.34	5.98	5.83	8.69
S7	12.85	12.02	9.17	8.09	7.47	7.08	6.76	6.35	6.00	5.82	8.69
S8	12.82	11.98	9.13	8.07	7.47	7.08	6.77	6.36	6.01	5.84	8.67

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。