

PSJ 予測統計値  
(平均値)

2007年 2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,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	13.57	13.03	9.87	8.45	7.65	7.16	6.79	6.32	5.96	5.74 /	9.31
2	13.52	12.96	9.78	8.42	7.65	7.16	6.79	6.33	5.96	5.83 /	9.13
3	13.69	13.10	9.87	8.46	7.68	7.20	6.81	6.35	5.98	5.89 /	9.15
4	13.08	12.46	9.34	8.19	7.52	7.08	6.78	6.33	5.96	6.04 /	9.11
5	13.01	12.40	9.30	8.16	7.49	7.07	6.78	6.33	5.96	6.12 /	9.31
6	13.06	12.44	9.31	8.18	7.53	7.11	6.81	6.36	5.99	6.23 /	9.14
7	13.05	12.43	9.27	8.19	7.56	7.13	6.84	6.40	6.03	6.27 /	9.26
8	12.98	12.33	9.20	8.15	7.53	7.11	6.81	6.37	6.00	6.31 /	8.93
9	12.53	11.86	8.95	8.01	7.42	7.01	6.73	6.31	5.95	6.26 /	8.57
10	12.44	11.76	8.91	8.00	7.44	7.04	6.77	6.35	5.99	6.26 /	8.53
11	12.25	11.52	8.76	7.91	7.36	6.98	6.72	6.30	5.95	6.35 /	8.24
12	12.40	11.67	8.71	7.92	7.40	7.03	6.79	6.38	6.02	6.15 /	8.99
13	12.12	11.41	8.61	7.81	7.29	6.92	6.68	6.29	5.95	5.84 /	9.31
14	12.17	11.46	8.60	7.78	7.25	6.88	6.63	6.23	5.90	6.02 /	8.72
15	12.13	11.40	8.57	7.76	7.24	6.87	6.62	6.23	5.89	5.97 /	8.76
16	12.11	11.38	8.56	7.77	7.25	6.88	6.65	6.25	5.91	5.97 /	9.04
17	12.06	11.33	8.54	7.75	7.24	6.87	6.63	6.24	5.90	5.90 /	8.83
18	12.05	11.30	8.52	7.74	7.24	6.88	6.64	6.25	5.91	5.84 /	8.96
19	12.03	11.27	8.51	7.74	7.24	6.89	6.65	6.26	5.92	5.84 /	8.96
20	12.29	11.52	8.60	7.78	7.28	6.92	6.68	6.29	5.95	6.29 /	8.67
21	12.34	11.54	8.60	7.81	7.33	6.97	6.73	6.34	6.00	6.21 /	9.02
22	12.42	11.63	8.61	7.80	7.32	6.96	6.69	6.31	5.96	6.16 /	8.70
23	12.62	11.82	8.72	7.85	7.35	7.00	6.72	6.33	5.98	6.28 /	8.68
24	12.66	11.86	8.81	7.90	7.36	7.02	6.74	6.35	6.01	6.25 /	8.66
25	12.46	11.63	8.61	7.79	7.31	6.97	6.71	6.32	5.98	6.28 /	8.45
26	12.10	11.26	8.43	7.71	7.24	6.92	6.69	6.30	5.96	6.21 /	8.87
27	11.89	11.00	8.32	7.65	7.23	6.91	6.69	6.31	5.97	6.06 /	8.39
28	12.19	11.31	8.42	7.69	7.23	6.90	6.68	6.30	5.96	6.37 /	8.41
29	11.85	10.93	8.32	7.68	7.27	6.95	6.74	6.36	6.02	6.07 /	8.96
30	12.18	11.23	8.56	7.90	7.48	7.14	6.92	6.52	6.17	6.07 /	9.75
31	11.61	10.66	8.23	7.64	7.24	6.94	6.73	6.36	6.02	6.07 /	9.11
32	11.28	10.32	8.06	7.52	7.13	6.86	6.66	6.29	5.95	6.06 /	8.47
33	11.68	10.71	8.20	7.61	7.22	6.91	6.70	6.32	5.98	6.18 /	8.64
34	11.45	10.44	8.11	7.54	7.13	6.87	6.67	6.29	5.95	6.07 /	8.57
35	11.54	10.53	8.11	7.54	7.13	6.86	6.65	6.28	5.94	6.13 /	8.48
36	11.89	10.92	8.26	7.65	7.25	6.93	6.72	6.35	6.00	6.17 /	8.90
37	11.87	10.86	8.28	7.64	7.22	6.92	6.70	6.33	5.99	6.18 /	8.79
38	12.17	11.19	8.37	7.68	7.25	6.92	6.70	6.32	5.98	6.32 /	8.43
39	12.15	11.12	8.36	7.71	7.29	6.97	6.75	6.37	6.03	6.37 /	9.06
40	12.70	11.71	8.60	7.83	7.37	7.03	6.76	6.38	6.04	6.49 /	8.89
41	12.32	11.26	8.42	7.73	7.30	6.97	6.74	6.36	6.01	6.37 /	9.12
42	12.96	11.91	8.85	8.02	7.48	7.14	6.87	6.47	6.12	6.53 /	9.61
43	13.30	12.27	8.95	8.02	7.45	7.11	6.80	6.41	6.06	6.59 /	8.69
44	14.00	13.00	9.34	8.21	7.59	7.22	6.90	6.45	6.11	6.79 /	8.96
45	13.78	12.72	9.16	8.14	7.54	7.19	6.87	6.45	6.10	6.69 /	9.14
46	13.88	12.83	9.16	8.12	7.53	7.18	6.86	6.44	6.09	6.73 /	8.99
47	13.92	12.83	9.08	8.06	7.52	7.17	6.84	6.42	6.08	6.75 /	8.75
48	13.31	12.16	8.76	7.93	7.42	7.10	6.81	6.42	6.07	6.61 /	8.95
49	13.30	12.14	8.70	7.87	7.39	7.05	6.77	6.38	6.03	6.64 /	8.52
50	14.04	12.90	9.06	8.09	7.57	7.22	6.89	6.48	6.13	6.79 /	9.36
51	13.69	12.50	8.83	7.95	7.45	7.11	6.81	6.41	6.07	6.64 /	8.73

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	
S1	12.94	12.33	9.50	8.22	7.46	7.03	6.67	6.24	5.90	5.78 / 9.05
S2	12.98	12.36	9.54	8.25	7.48	7.03	6.68	6.25	5.91	5.90 / 9.06
S3	13.55	12.95	9.83	8.43	7.67	7.20	6.82	6.36	6.01	5.91 / 9.44
S4	12.92	12.29	9.39	8.18	7.47	7.03	6.69	6.26	5.92	5.96 / 9.04
S5	12.92	12.28	9.38	8.17	7.47	7.03	6.70	6.27	5.93	5.92 / 8.93
S6	12.81	12.18	9.36	8.16	7.42	6.99	6.68	6.25	5.91	6.06 / 9.00
S7	12.81	12.18	9.36	8.15	7.42	6.98	6.67	6.25	5.90	6.00 / 8.98
S8	12.76	12.13	9.31	8.12	7.39	6.98	6.66	6.24	5.90	6.02 / 8.99
S9	12.70	12.07	9.25	8.07	7.37	6.95	6.63	6.22	5.88	5.96 / 8.94
S10	12.70	12.06	9.23	8.05	7.37	6.95	6.63	6.21	5.88	5.95 / 9.10

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。