

PSJ 予測統計値
(中央値)

2007年 1月 15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	11.99	11.99	8.47	7.89	7.36	7.05	6.91	6.65	6.20	5.75 /	9.21
2	11.99	11.99	8.85	7.85	7.33	7.07	7.00	6.71	6.18	5.83 /	9.21
3	12.20	12.20	8.40	7.91	7.42	7.15	6.99	6.73	6.21	5.90 /	9.20
4	11.54	11.54	8.28	7.69	7.30	7.17	6.77	6.63	6.20	6.05 /	8.94
5	11.18	11.17	8.65	7.50	7.37	7.14	6.78	6.47	6.06	6.13 /	8.53
6	11.56	11.51	8.35	7.68	7.41	7.11	6.82	6.57	6.06	6.23 /	8.67
7	11.78	11.78	8.45	7.77	7.34	7.05	6.94	6.65	6.35	6.27 /	9.41
8	11.49	11.49	8.29	7.75	7.36	7.08	6.82	6.69	6.38	6.30 /	9.08
9	11.52	11.49	8.22	7.77	7.31	7.09	6.84	6.52	6.00	6.12 /	8.31
10	11.43	11.42	8.34	7.81	7.24	6.98	6.84	6.69	6.38	6.12 /	8.62
11	11.26	11.20	8.17	7.82	7.25	6.97	6.88	6.66	6.37	5.84 /	8.37
12	10.98	10.84	8.14	7.85	7.29	7.08	6.97	6.70	6.41	6.27 /	9.15
13	11.16	11.01	8.23	7.94	7.37	7.06	6.95	6.64	6.34	5.80 /	9.46
14	11.24	11.13	8.35	7.89	7.20	6.94	6.91	6.60	6.31	6.00 /	8.76
15	11.19	11.05	8.24	7.89	7.21	6.92	6.92	6.66	6.36	5.93 /	8.92
16	11.12	10.97	8.22	7.89	7.30	7.06	6.93	6.64	6.35	5.93 /	9.19
17	11.14	10.99	8.22	7.85	7.27	7.03	6.95	6.65	6.35	5.86 /	8.98
18	11.08	10.89	8.17	7.87	7.35	7.07	6.95	6.63	6.34	5.80 /	9.11
19	11.03	10.80	8.15	7.84	7.34	7.09	6.97	6.68	6.38	5.80 /	9.11
20	11.83	11.27	8.27	7.76	7.29	7.01	6.90	6.75	6.43	6.54 /	8.72
21	11.81	11.16	8.23	7.72	7.38	7.05	6.91	6.76	6.54	6.63 /	9.17
22	12.10	11.31	8.36	7.78	7.28	7.03	6.89	6.81	6.52	6.64 /	8.86
23	12.15	11.32	8.32	7.73	7.30	7.02	6.88	6.80	6.55	6.67 /	8.84
24	11.95	11.21	8.34	7.76	7.33	6.99	6.86	6.78	6.59	6.69 /	8.82
25	11.44	11.00	8.38	7.69	7.23	6.98	6.80	6.71	6.64	6.66 /	8.60
26	11.19	10.77	8.22	7.56	7.15	6.99	6.87	6.74	6.47	6.56 /	8.91
27	9.89	9.70	8.09	7.53	7.22	6.94	6.81	6.71	6.65	6.53 /	8.50
28	10.80	10.33	8.30	7.72	7.20	6.90	6.76	6.68	6.63	6.60 /	8.55
29	9.77	9.58	8.00	7.70	7.29	6.89	6.78	6.68	6.62	6.44 /	9.06
30	9.74	9.60	8.07	7.76	7.30	6.88	6.76	6.49	6.62	6.44 /	9.85
31	9.51	9.38	8.00	7.69	7.19	6.84	6.75	6.68	6.37	6.35 /	9.20
32	9.36	9.22	7.91	7.54	7.09	6.82	6.75	6.66	6.49	6.30 /	8.45
33	9.69	9.54	8.04	7.40	7.10	6.84	6.76	6.66	6.61	6.38 /	8.73
34	9.37	9.25	7.85	7.57	7.05	6.90	6.73	6.63	6.42	6.29 /	8.66
35	9.49	9.36	7.90	7.61	7.06	6.80	6.69	6.65	6.49	6.31 /	8.57
36	9.91	9.70	8.02	7.69	7.15	6.83	6.74	6.65	6.60	6.40 /	9.00
37	9.79	9.59	8.02	7.50	7.06	6.86	6.74	6.65	6.60	6.37 /	8.89
38	10.17	9.95	8.04	7.69	7.32	6.88	6.68	6.65	6.58	6.43 /	8.45
39	10.02	9.78	8.06	7.49	7.25	6.90	6.75	6.65	6.61	6.41 /	9.17
40	10.71	10.38	8.23	7.71	7.44	6.97	6.74	6.64	6.59	6.53 /	9.01
41	10.14	9.89	8.09	7.57	7.28	6.85	6.61	6.45	6.45	6.46 /	9.23
42	10.75	10.42	8.08	7.68	7.39	6.99	6.84	6.66	6.61	6.53 /	9.73
43	11.45	10.98	8.21	7.73	7.56	7.08	6.75	6.65	6.61	6.62 /	8.84
44	12.88	12.08	8.61	7.86	7.64	7.26	6.78	6.58	6.58	6.78 /	9.11
45	12.28	11.67	8.60	7.75	7.57	7.16	6.76	6.63	6.62	6.69 /	9.31
46	12.47	11.82	8.62	7.76	7.58	7.19	6.77	6.63	6.60	6.73 /	9.18
47	12.59	11.91	8.59	7.74	7.58	7.18	6.79	6.56	6.56	6.75 /	8.87
48	11.27	10.75	8.38	7.66	7.47	7.01	6.79	6.69	6.54	6.61 /	9.09
49	11.27	10.76	8.22	7.67	7.46	7.01	6.72	6.61	6.52	6.64 /	8.64
50	12.90	11.87	8.76	7.72	7.55	7.15	6.85	6.68	6.53	6.80 /	9.56
S1	12.57	12.14	9.70	8.13	7.45	6.95	6.93	6.70	6.16	5.82 /	9.22

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,日興フィクグループ

回号	Yield Curve Scenarios (%)									最低 / 最高 (%)
	-300bp	-200bp	-100bp	-50bp	0bp	50bp	100bp	200bp	300bp	
S2	12.86	12.11	9.66	8.12	7.44	6.98	6.97	6.66	6.15	5.92 / 9.11
S3	12.38	12.29	9.03	8.15	7.46	6.97	6.96	6.65	6.16	5.92 / 9.16
S4	12.19	12.10	8.93	8.10	7.61	7.12	6.94	6.71	6.19	5.92 / 9.07
S5	12.61	12.40	8.63	7.82	7.56	7.16	7.05	6.75	6.23	5.92 / 9.10
S6	11.76	11.64	9.27	7.87	7.35	7.17	6.80	6.64	6.20	6.03 / 9.12
S7	11.77	11.64	9.27	7.90	7.65	7.23	6.80	6.65	6.20	6.01 / 9.13
S8	11.76	11.64	9.25	7.87	7.65	7.23	6.80	6.66	6.20	6.02 / 9.13
S9	11.75	11.55	9.22	7.85	7.61	7.23	6.80	6.66	6.19	5.97 / 9.09
S10	11.77	11.61	8.88	7.83	7.64	7.23	6.80	6.65	6.16	5.88 / 9.07

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。