

PSJ 予測統計値
(中央値)

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・スチール,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・ピッチ日本,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	12.76	12.76	10.08	7.88	7.50	7.06	6.90	6.53	6.01	5.74 /	9.31
2	12.81	12.81	10.22	7.85	7.48	7.03	6.94	6.50	6.08	5.83 /	9.13
3	13.28	13.28	10.28	7.87	7.60	7.08	6.92	6.56	6.09	5.89 /	9.15
4	11.62	11.62	9.40	7.92	7.26	7.10	6.87	6.50	6.05	6.04 /	9.11
5	11.16	11.16	8.98	7.63	7.39	7.04	6.78	6.43	5.83	6.12 /	9.31
6	11.64	11.64	9.30	7.86	7.49	7.05	6.82	6.54	5.98	6.23 /	9.14
7	12.39	12.38	9.22	8.27	7.46	7.07	6.84	6.54	5.99	6.27 /	9.26
8	12.06	12.03	9.22	8.05	7.45	7.00	6.81	6.55	5.98	6.31 /	8.93
9	11.78	11.78	9.00	7.85	7.40	7.00	6.83	6.40	5.95	6.26 /	8.57
10	12.12	12.12	8.82	8.05	7.31	7.00	6.83	6.46	5.90	6.26 /	8.53
11	11.78	11.71	8.52	7.84	7.19	7.00	6.79	6.39	5.86	6.35 /	8.24
12	12.02	11.57	8.15	7.91	7.39	7.01	6.92	6.28	5.91	6.15 /	8.99
13	11.16	11.06	8.21	7.93	7.21	6.94	6.80	6.31	5.91	5.84 /	9.31
14	11.23	11.13	8.26	7.86	7.23	6.93	6.80	6.35	5.91	6.02 /	8.72
15	11.19	11.05	8.19	7.86	7.16	6.94	6.84	6.30	5.91	5.97 /	8.76
16	11.12	10.98	8.19	7.88	7.17	6.92	6.82	6.28	5.91	5.97 /	9.04
17	11.13	10.99	8.21	7.92	7.15	6.94	6.83	6.28	5.93	5.90 /	8.83
18	11.11	10.92	8.17	7.92	7.09	6.95	6.81	6.26	5.94	5.84 /	8.96
19	11.03	10.84	8.16	7.93	7.13	6.97	6.86	6.25	5.97	5.84 /	8.96
20	11.84	11.43	8.19	7.85	7.18	6.95	6.88	6.21	5.99	6.29 /	8.67
21	11.78	11.34	8.26	7.79	7.29	7.04	6.86	6.18	6.05	6.21 /	9.02
22	12.11	11.48	8.32	7.84	7.23	7.05	6.86	6.22	6.04	6.16 /	8.70
23	12.14	11.49	8.35	7.83	7.22	7.07	6.83	6.21	6.05	6.28 /	8.68
24	11.96	11.37	8.38	7.80	7.31	7.05	6.79	6.20	6.08	6.25 /	8.66
25	11.46	11.05	8.40	7.66	7.24	7.00	6.72	6.16	6.10	6.28 /	8.45
26	11.20	10.83	8.24	7.63	7.18	7.00	6.72	6.08	6.07	6.21 /	8.87
27	9.88	9.69	8.17	7.64	7.18	6.95	6.60	6.16	6.15	6.06 /	8.39
28	10.80	10.36	8.32	7.54	7.17	6.80	6.66	6.12	6.12	6.37 /	8.41
29	9.74	9.58	7.93	7.67	7.33	6.91	6.52	6.19	6.18	6.07 /	8.96
30	9.70	9.58	7.89	7.72	7.32	6.91	6.80	6.31	6.18	6.07 /	9.75
31	9.50	9.37	7.81	7.66	7.20	6.78	6.54	6.20	6.18	6.07 /	9.11
32	9.34	9.23	7.80	7.41	7.08	6.74	6.49	6.21	6.21	6.06 /	8.47
33	9.67	9.52	7.83	7.47	7.11	6.82	6.50	6.21	6.20	6.18 /	8.64
34	9.36	9.23	7.79	7.33	6.99	6.82	6.49	6.21	6.20	6.07 /	8.57
35	9.47	9.31	7.82	7.33	6.99	6.74	6.52	6.21	6.20	6.13 /	8.48
36	9.90	9.69	7.82	7.57	7.16	6.84	6.62	6.28	6.21	6.17 /	8.90
37	9.76	9.58	7.81	7.39	7.08	6.83	6.62	6.29	6.21	6.18 /	8.79
38	10.17	9.94	7.89	7.46	7.06	6.83	6.62	6.27	6.22	6.32 /	8.43
39	9.96	9.78	7.87	7.58	7.19	6.85	6.65	6.29	6.21	6.37 /	9.06
40	10.65	10.39	8.08	7.62	7.17	6.98	6.67	6.32	6.19	6.49 /	8.89
41	10.11	9.89	7.86	7.41	7.14	6.85	6.56	6.33	6.23	6.37 /	9.12
42	10.69	10.41	8.06	7.70	7.32	7.04	6.82	6.46	6.22	6.53 /	9.61
43	11.44	11.06	8.24	7.66	7.19	6.99	6.75	6.41	6.22	6.59 /	8.69
44	12.87	12.13	8.63	7.81	7.25	7.02	6.83	6.47	6.23	6.79 /	8.96
45	12.24	11.68	8.49	7.77	7.30	7.07	6.74	6.50	6.22	6.69 /	9.14
46	12.43	11.83	8.44	7.77	7.28	7.04	6.75	6.49	6.22	6.73 /	8.99
47	12.58	11.94	8.46	7.76	7.32	7.09	6.76	6.52	6.23	6.75 /	8.75
48	11.24	10.80	8.38	7.68	7.33	7.00	6.74	6.50	6.24	6.61 /	8.95
49	11.23	10.79	8.28	7.67	7.26	7.01	6.61	6.44	6.24	6.64 /	8.52
50	12.82	11.77	8.56	7.81	7.46	6.96	6.78	6.62	6.31	6.79 /	9.36
51	11.84	11.22	8.36	7.79	7.36	7.06	6.66	6.52	6.23	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・リーマン・ブラザーズ、BNPパリバ、JPモルガン、みずほ、UBS、メリル・ピッチ日本、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	12.26	12.21	9.70	7.73	7.33	6.90	6.74	6.39	6.07	5.78 / 9.05
S2	12.23	12.18	9.96	7.97	7.33	6.94	6.72	6.39	6.04	5.90 / 9.06
S3	12.41	12.40	10.13	8.05	7.43	6.96	6.94	6.53	6.02	5.91 / 9.44
S4	12.25	12.14	9.13	7.61	7.36	6.89	6.76	6.52	6.09	5.96 / 9.04
S5	12.61	12.60	8.82	7.58	7.51	7.08	7.01	6.65	6.07	5.92 / 8.93
S6	11.84	11.72	9.57	8.00	7.22	6.92	6.75	6.51	6.06	6.06 / 9.00
S7	11.82	11.73	9.58	8.02	7.23	6.88	6.76	6.51	6.06	6.00 / 8.98
S8	11.81	11.70	9.56	7.58	7.22	6.88	6.76	6.51	6.06	6.02 / 8.99
S9	11.78	11.66	9.55	7.51	7.22	6.85	6.75	6.49	6.06	5.96 / 8.94
S10	11.80	11.65	9.09	7.51	7.22	6.87	6.75	6.50	6.05	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。）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。