

PSJ 予測統計値
(中央値)

2007年 2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	12.74	12.44	9.85	7.87	7.46	7.06	6.78	6.52	5.68	5.71 /	9.28
2	12.79	12.62	9.94	7.87	7.42	7.02	6.85	6.47	5.59	5.80 /	9.11
3	13.26	12.74	9.98	7.88	7.57	7.00	6.95	6.51	5.58	5.86 /	9.12
4	11.61	11.61	9.24	7.84	7.31	7.05	6.81	6.47	5.58	6.01 /	9.08
5	11.15	11.04	8.79	7.66	7.28	7.15	6.78	6.32	5.68	6.09 /	9.27
6	11.63	11.58	9.11	7.78	7.34	7.13	6.81	6.48	5.74	6.20 /	9.11
7	12.32	11.82	9.15	8.22	7.39	7.09	6.80	6.40	5.71	6.27 /	9.15
8	12.05	11.89	9.15	7.95	7.36	7.10	6.77	6.25	5.78	6.29 /	8.83
9	11.78	11.76	8.96	7.78	7.32	7.08	6.71	6.08	5.79	6.24 /	8.52
10	12.12	11.62	8.75	7.98	7.24	7.09	6.82	6.05	5.82	6.30 /	8.48
11	11.78	11.36	8.45	7.74	7.21	7.01	6.71	5.89	5.85	6.35 /	8.16
12	11.98	10.97	8.14	7.83	7.38	6.92	6.92	6.06	5.90	6.17 /	8.93
13	11.09	10.94	8.23	7.72	7.15	6.92	6.49	5.93	5.90	5.79 /	9.23
14	11.17	11.02	8.27	7.69	7.16	6.92	6.55	5.93	5.90	6.00 /	8.64
15	11.12	10.94	8.20	7.69	7.18	6.91	6.53	5.93	5.91	5.92 /	8.69
16	11.05	10.86	8.19	7.68	7.17	6.87	6.48	5.93	5.92	5.92 /	8.97
17	11.07	10.88	8.21	7.74	7.18	6.88	6.45	5.95	5.93	5.86 /	8.76
18	11.02	10.82	8.17	7.76	7.16	6.86	6.43	5.95	5.94	5.79 /	8.89
19	10.97	10.73	8.14	7.74	7.21	6.84	6.40	5.98	5.95	5.79 /	8.90
20	11.83	10.86	8.14	7.79	7.23	6.80	6.43	6.00	5.99	6.25 /	8.61
21	11.75	10.76	8.07	7.74	7.26	6.77	6.35	6.05	6.03	6.23 /	8.96
22	12.07	10.94	8.20	7.79	7.21	6.95	6.40	6.07	6.02	6.19 /	8.64
23	12.10	10.97	8.26	7.75	7.20	6.91	6.40	6.07	6.04	6.29 /	8.62
24	11.92	10.85	8.19	7.70	7.28	6.88	6.41	6.12	6.07	6.29 /	8.59
25	11.42	10.65	8.20	7.66	7.17	6.81	6.43	6.12	6.09	6.30 /	8.40
26	11.17	10.37	8.08	7.58	7.10	6.63	6.35	6.06	6.05	6.23 /	8.83
27	9.78	9.57	8.10	7.53	7.13	6.61	6.43	6.14	6.13	6.06 /	8.38
28	10.80	10.28	8.12	7.54	7.10	6.64	6.40	6.11	6.09	6.40 /	8.38
29	9.66	9.46	7.93	7.47	7.11	6.69	6.51	6.19	6.14	6.09 /	8.95
30	9.62	9.46	7.98	7.45	7.11	6.89	6.78	6.31	6.15	5.96 /	9.75
31	9.38	9.23	7.89	7.38	7.03	6.73	6.53	6.21	6.14	6.03 /	9.11
32	9.23	9.09	7.78	7.32	7.01	6.67	6.48	6.19	6.18	6.07 /	8.47
33	9.56	9.41	7.96	7.39	7.08	6.68	6.49	6.18	6.17	6.12 /	8.64
34	9.23	9.11	7.77	7.27	6.95	6.81	6.49	6.18	6.17	6.08 /	8.59
35	9.36	9.20	7.74	7.21	6.94	6.72	6.51	6.20	6.18	6.14 /	8.49
36	9.80	9.58	7.93	7.38	7.09	6.81	6.61	6.28	6.17	6.19 /	8.90
37	9.66	9.46	7.93	7.33	7.03	6.82	6.61	6.29	6.17	6.19 /	8.80
38	10.08	9.82	7.97	7.42	7.01	6.80	6.61	6.27	6.19	6.34 /	8.43
39	9.89	9.66	7.97	7.40	7.07	6.84	6.64	6.29	6.18	6.31 /	9.08
40	10.61	10.29	8.02	7.60	7.07	6.96	6.66	6.32	6.17	6.50 /	8.88
41	10.01	9.75	7.87	7.38	7.03	6.79	6.57	6.33	6.20	6.38 /	9.13
42	10.65	10.32	7.98	7.59	7.26	7.03	6.82	6.46	6.19	6.46 /	9.59
43	11.40	10.70	8.19	7.61	7.16	6.95	6.71	6.41	6.18	6.60 /	8.66
44	12.83	12.05	8.56	7.83	7.24	6.98	6.77	6.47	6.20	6.75 /	8.84
45	12.23	11.61	8.39	7.75	7.27	6.96	6.71	6.51	6.23	6.67 /	9.10
46	12.41	11.76	8.44	7.76	7.27	6.95	6.72	6.49	6.21	6.71 /	8.93
47	12.57	11.86	8.43	7.75	7.30	6.93	6.65	6.52	6.23	6.71 /	8.64
48	11.23	10.66	8.26	7.64	7.10	6.92	6.73	6.50	6.21	6.58 /	8.96
49	11.20	10.55	8.14	7.64	7.12	6.91	6.62	6.44	6.19	6.60 /	8.48
50	12.81	11.75	8.48	7.74	7.35	6.95	6.75	6.62	6.32	6.75 /	9.35
51	11.84	11.13	8.23	7.67	7.21	6.89	6.71	6.52	6.24	6.66 /	8.70

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	12.25	12.06	9.53	7.70	7.31	6.77	6.72	6.14	5.69	5.76 / 8.91
S2	12.21	12.06	9.59	7.86	7.30	6.77	6.74	6.12	5.70	5.87 / 8.91
S3	12.41	12.04	9.58	8.15	7.42	6.95	6.77	6.53	5.72	5.87 / 9.41
S4	12.25	12.00	9.00	7.60	7.34	6.88	6.76	6.10	5.77	5.93 / 8.87
S5	12.66	11.96	8.71	7.55	7.57	6.93	6.86	6.08	5.78	5.88 / 8.76
S6	11.82	11.69	9.40	7.94	7.17	6.85	6.76	6.06	5.86	6.03 / 8.83
S7	11.81	11.70	9.41	8.00	7.17	6.82	6.76	6.07	5.87	5.97 / 8.82
S8	11.80	11.66	9.42	7.56	7.18	6.81	6.76	6.05	5.87	6.00 / 8.82
S9	11.78	11.60	9.38	7.53	7.18	6.78	6.76	6.04	5.88	5.99 / 8.78
S10	11.79	11.63	9.12	7.51	7.18	6.79	6.76	6.04	5.89	5.99 / 8.79

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。