

PSJ 予測統計値
(平均値)

2007年 3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・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 | 13.08 | 12.55 | 9.69 | 8.29 | 7.45 | 6.96 | 6.61 | 6.14 | 5.83 | 5.65 / | 9.15 |
| 2 | 13.09 | 12.53 | 9.64 | 8.26 | 7.46 | 6.97 | 6.62 | 6.16 | 5.84 | 5.73 / | 9.08 |
| 3 | 13.22 | 12.66 | 9.70 | 8.31 | 7.49 | 7.00 | 6.64 | 6.18 | 5.86 | 5.80 / | 9.08 |
| 4 | 12.62 | 12.03 | 9.18 | 8.03 | 7.34 | 6.89 | 6.62 | 6.17 | 5.84 | 5.97 / | 8.83 |
| 5 | 12.48 | 11.90 | 9.10 | 7.98 | 7.30 | 6.88 | 6.62 | 6.17 | 5.84 | 6.07 / | 8.43 |
| 6 | 12.56 | 11.97 | 9.12 | 8.01 | 7.34 | 6.90 | 6.64 | 6.20 | 5.87 | 6.17 / | 8.58 |
| 7 | 12.62 | 12.01 | 9.19 | 8.05 | 7.39 | 6.96 | 6.70 | 6.26 | 5.93 | 6.22 / | 9.41 |
| 8 | 12.57 | 11.96 | 9.06 | 8.00 | 7.35 | 6.92 | 6.65 | 6.23 | 5.89 | 6.27 / | 8.98 |
| 9 | 12.17 | 11.53 | 8.82 | 7.84 | 7.24 | 6.83 | 6.57 | 6.16 | 5.84 | 6.20 / | 8.35 |
| 10 | 12.10 | 11.45 | 8.79 | 7.85 | 7.27 | 6.88 | 6.63 | 6.22 | 5.89 | 6.18 / | 8.62 |
| 11 | 11.97 | 11.30 | 8.62 | 7.75 | 7.20 | 6.81 | 6.58 | 6.17 | 5.85 | 5.86 / | 8.25 |
| 12 | 12.04 | 11.37 | 8.56 | 7.74 | 7.22 | 6.87 | 6.64 | 6.24 | 5.91 | 6.19 / | 9.01 |
| 13 | 12.11 | 11.45 | 8.67 | 7.83 | 7.28 | 6.89 | 6.66 | 6.26 | 5.93 | 5.89 / | 9.32 |
| 14 | 12.16 | 11.50 | 8.67 | 7.79 | 7.24 | 6.85 | 6.61 | 6.21 | 5.88 | 6.10 / | 8.73 |
| 15 | 12.13 | 11.46 | 8.64 | 7.79 | 7.24 | 6.85 | 6.62 | 6.21 | 5.89 | 6.03 / | 8.87 |
| 16 | 12.09 | 11.42 | 8.62 | 7.78 | 7.24 | 6.86 | 6.63 | 6.22 | 5.90 | 6.03 / | 9.06 |
| 17 | 12.06 | 11.38 | 8.59 | 7.76 | 7.23 | 6.84 | 6.62 | 6.22 | 5.89 | 5.96 / | 8.84 |
| 18 | 12.02 | 11.34 | 8.57 | 7.75 | 7.22 | 6.85 | 6.62 | 6.22 | 5.90 | 5.89 / | 8.97 |
| 19 | 12.02 | 11.32 | 8.57 | 7.75 | 7.23 | 6.86 | 6.63 | 6.23 | 5.91 | 5.89 / | 8.98 |
| 20 | 12.28 | 11.58 | 8.67 | 7.78 | 7.26 | 6.90 | 6.66 | 6.26 | 5.93 | 6.29 / | 8.68 |
| 21 | 12.33 | 11.61 | 8.68 | 7.83 | 7.33 | 6.96 | 6.72 | 6.33 | 5.99 | 6.27 / | 9.13 |
| 22 | 12.41 | 11.70 | 8.68 | 7.81 | 7.31 | 6.93 | 6.68 | 6.28 | 5.95 | 6.23 / | 8.72 |
| 23 | 12.60 | 11.88 | 8.80 | 7.87 | 7.34 | 6.97 | 6.70 | 6.30 | 5.97 | 6.33 / | 8.70 |
| 24 | 12.64 | 11.93 | 8.88 | 7.93 | 7.36 | 6.99 | 6.73 | 6.33 | 6.00 | 6.31 / | 8.67 |
| 25 | 12.44 | 11.70 | 8.68 | 7.81 | 7.30 | 6.95 | 6.70 | 6.30 | 5.98 | 6.34 / | 8.46 |
| 26 | 12.07 | 11.31 | 8.49 | 7.71 | 7.22 | 6.90 | 6.67 | 6.28 | 5.95 | 6.25 / | 8.89 |
| 27 | 11.86 | 11.07 | 8.38 | 7.67 | 7.22 | 6.90 | 6.68 | 6.30 | 5.98 | 6.10 / | 8.52 |
| 28 | 12.17 | 11.38 | 8.48 | 7.71 | 7.23 | 6.89 | 6.66 | 6.28 | 5.95 | 6.44 / | 8.44 |
| 29 | 11.79 | 10.98 | 8.37 | 7.69 | 7.26 | 6.95 | 6.73 | 6.34 | 6.02 | 6.06 / | 9.00 |
| 30 | 11.81 | 10.97 | 8.45 | 7.78 | 7.35 | 7.04 | 6.82 | 6.44 | 6.10 | 6.01 / | 9.79 |
| 31 | 11.54 | 10.70 | 8.26 | 7.64 | 7.22 | 6.93 | 6.72 | 6.34 | 6.01 | 6.05 / | 9.15 |
| 32 | 11.21 | 10.35 | 8.09 | 7.52 | 7.11 | 6.85 | 6.65 | 6.27 | 5.95 | 6.10 / | 8.51 |
| 33 | 11.64 | 10.78 | 8.25 | 7.62 | 7.21 | 6.91 | 6.69 | 6.31 | 5.99 | 6.16 / | 8.77 |
| 34 | 11.37 | 10.48 | 8.15 | 7.55 | 7.12 | 6.87 | 6.66 | 6.28 | 5.95 | 6.12 / | 8.62 |
| 35 | 11.47 | 10.58 | 8.15 | 7.54 | 7.12 | 6.86 | 6.64 | 6.26 | 5.94 | 6.17 / | 8.52 |
| 36 | 11.85 | 10.99 | 8.30 | 7.66 | 7.25 | 6.93 | 6.71 | 6.33 | 6.00 | 6.23 / | 8.94 |
| 37 | 11.81 | 10.93 | 8.33 | 7.66 | 7.22 | 6.92 | 6.70 | 6.32 | 5.99 | 6.24 / | 8.84 |
| 38 | 12.14 | 11.27 | 8.43 | 7.70 | 7.25 | 6.92 | 6.69 | 6.31 | 5.98 | 6.37 / | 8.47 |
| 39 | 12.12 | 11.20 | 8.43 | 7.74 | 7.30 | 6.98 | 6.75 | 6.37 | 6.04 | 6.35 / | 9.21 |
| 40 | 12.67 | 11.79 | 8.67 | 7.85 | 7.37 | 7.02 | 6.76 | 6.37 | 6.04 | 6.54 / | 8.94 |
| 41 | 12.25 | 11.33 | 8.47 | 7.74 | 7.29 | 6.96 | 6.73 | 6.34 | 6.01 | 6.36 / | 9.18 |
| 42 | 12.92 | 12.00 | 8.92 | 8.06 | 7.48 | 7.13 | 6.87 | 6.46 | 6.12 | 6.52 / | 9.65 |
| 43 | 13.29 | 12.38 | 9.04 | 8.07 | 7.46 | 7.10 | 6.80 | 6.40 | 6.06 | 6.66 / | 8.74 |
| 44 | 14.01 | 13.11 | 9.45 | 8.27 | 7.60 | 7.21 | 6.88 | 6.44 | 6.10 | 6.84 / | 8.95 |
| 45 | 13.78 | 12.85 | 9.26 | 8.20 | 7.56 | 7.18 | 6.86 | 6.44 | 6.11 | 6.76 / | 9.21 |
| 46 | 13.89 | 12.96 | 9.27 | 8.18 | 7.55 | 7.18 | 6.85 | 6.43 | 6.10 | 6.78 / | 9.04 |
| 47 | 13.94 | 12.96 | 9.19 | 8.12 | 7.52 | 7.17 | 6.83 | 6.42 | 6.08 | 6.78 / | 8.74 |
| 48 | 13.28 | 12.28 | 8.85 | 7.97 | 7.43 | 7.09 | 6.81 | 6.41 | 6.08 | 6.67 / | 9.03 |
| 49 | 13.28 | 12.27 | 8.79 | 7.91 | 7.38 | 7.05 | 6.77 | 6.37 | 6.03 | 6.67 / | 8.54 |
| 50 | 14.05 | 13.04 | 9.17 | 8.15 | 7.58 | 7.23 | 6.89 | 6.48 | 6.14 | 6.78 / | 9.44 |
| 51 | 13.59 | 12.56 | 8.88 | 7.95 | 7.41 | 7.08 | 6.78 | 6.38 | 6.05 | 6.57 / | 8.77 |

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・ピッチ日本、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 | | |
| 52 | 13.41 | 12.34 | 8.82 | 7.96 | 7.42 | 7.11 | 6.85 | 6.47 | 6.13 | 6.57 | 9.15 |
| S1 | 12.95 | 12.36 | 9.61 | 8.28 | 7.46 | 7.00 | 6.65 | 6.21 | 5.89 | 5.74 | 9.23 |
| S2 | 12.96 | 12.37 | 9.64 | 8.28 | 7.46 | 6.99 | 6.64 | 6.18 | 5.87 | 5.78 | 8.99 |
| S3 | 12.99 | 12.40 | 9.61 | 8.26 | 7.47 | 6.99 | 6.64 | 6.19 | 5.88 | 5.80 | 9.03 |
| S4 | 12.92 | 12.32 | 9.49 | 8.22 | 7.46 | 7.00 | 6.66 | 6.22 | 5.90 | 5.89 | 9.08 |
| S5 | 12.93 | 12.33 | 9.49 | 8.23 | 7.47 | 7.01 | 6.68 | 6.24 | 5.92 | 5.87 | 9.10 |
| S6 | 12.82 | 12.22 | 9.47 | 8.22 | 7.43 | 6.97 | 6.66 | 6.21 | 5.89 | 6.00 | 9.05 |
| S7 | 12.82 | 12.23 | 9.48 | 8.22 | 7.42 | 6.97 | 6.66 | 6.22 | 5.89 | 5.98 | 9.08 |
| S8 | 12.77 | 12.17 | 9.42 | 8.17 | 7.40 | 6.95 | 6.64 | 6.20 | 5.88 | 5.96 | 9.07 |
| S9 | 12.72 | 12.12 | 9.36 | 8.13 | 7.37 | 6.93 | 6.62 | 6.19 | 5.87 | 5.96 | 9.02 |
| S10 | 12.68 | 12.08 | 9.33 | 8.10 | 7.35 | 6.92 | 6.61 | 6.17 | 5.85 | 5.97 | 9.03 |

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。