

PSJ 予測統計値  
(平均値)

2007年 3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	13.04	12.53	9.84	8.38	7.50	6.98	6.62	6.17	5.83	5.74 /	9.03
2	13.05	12.53	9.77	8.35	7.49	6.99	6.62	6.18	5.84	5.82 /	9.07
3	13.21	12.67	9.85	8.40	7.53	7.02	6.65	6.21	5.85	5.89 /	9.17
4	12.58	12.03	9.31	8.10	7.37	6.91	6.62	6.19	5.84	6.04 /	8.61
5	12.44	11.91	9.23	8.05	7.34	6.90	6.63	6.20	5.84	6.13 /	8.31
6	12.53	11.98	9.25	8.08	7.37	6.93	6.65	6.23	5.87	6.24 /	8.48
7	12.56	12.01	9.25	8.11	7.42	6.97	6.70	6.28	5.92	6.29 /	9.22
8	12.53	11.98	9.19	8.06	7.39	6.95	6.66	6.25	5.89	6.33 /	8.79
9	12.12	11.54	8.95	7.90	7.27	6.86	6.58	6.18	5.84	6.27 /	8.45
10	12.06	11.46	8.91	7.92	7.31	6.90	6.64	6.24	5.89	6.30 /	8.50
11	11.92	11.28	8.72	7.81	7.23	6.84	6.59	6.20	5.85	5.99 /	8.35
12	11.98	11.35	8.66	7.80	7.26	6.88	6.65	6.26	5.91	6.24 /	8.88
13	12.05	11.43	8.77	7.87	7.31	6.91	6.67	6.28	5.92	5.94 /	9.18
14	12.11	11.49	8.76	7.84	7.27	6.87	6.62	6.22	5.87	6.13 /	8.59
15	12.08	11.45	8.73	7.83	7.26	6.87	6.62	6.23	5.88	6.08 /	8.74
16	12.04	11.40	8.71	7.83	7.27	6.88	6.64	6.25	5.89	6.08 /	8.93
17	12.00	11.36	8.68	7.81	7.25	6.86	6.62	6.23	5.88	6.01 /	8.72
18	11.96	11.31	8.66	7.79	7.24	6.86	6.62	6.24	5.89	5.93 /	8.86
19	11.96	11.30	8.65	7.80	7.26	6.87	6.63	6.25	5.90	5.94 /	8.87
20	12.22	11.55	8.77	7.84	7.29	6.91	6.67	6.28	5.92	6.31 /	8.57
21	12.26	11.57	8.77	7.87	7.35	6.97	6.73	6.34	5.99	6.28 /	9.02
22	12.35	11.68	8.78	7.86	7.33	6.95	6.69	6.30	5.94	6.24 /	8.61
23	12.55	11.86	8.90	7.92	7.36	6.99	6.71	6.32	5.96	6.34 /	8.58
24	12.59	11.90	8.98	7.98	7.38	7.00	6.73	6.34	5.98	6.33 /	8.56
25	12.38	11.68	8.77	7.85	7.32	6.97	6.70	6.32	5.96	6.35 /	8.37
26	11.98	11.26	8.59	7.76	7.25	6.92	6.69	6.30	5.94	6.27 /	8.80
27	11.76	11.00	8.46	7.71	7.25	6.92	6.70	6.32	5.96	6.11 /	8.49
28	12.09	11.34	8.57	7.75	7.26	6.90	6.68	6.29	5.93	6.44 /	8.37
29	11.67	10.88	8.45	7.73	7.28	6.96	6.74	6.36	6.00	6.12 /	8.98
30	11.65	10.83	8.53	7.82	7.38	7.04	6.82	6.45	6.09	6.01 /	9.79
31	11.39	10.57	8.34	7.68	7.25	6.94	6.73	6.35	5.99	6.06 /	9.15
32	11.05	10.22	8.16	7.55	7.14	6.86	6.65	6.28	5.93	6.10 /	8.51
33	11.49	10.67	8.32	7.66	7.24	6.92	6.70	6.33	5.97	6.17 /	8.77
34	11.19	10.33	8.22	7.57	7.15	6.88	6.66	6.29	5.93	6.12 /	8.63
35	11.30	10.44	8.21	7.57	7.15	6.86	6.65	6.28	5.92	6.17 /	8.53
36	11.73	10.90	8.37	7.69	7.27	6.93	6.71	6.34	5.98	6.23 /	8.94
37	11.68	10.83	8.41	7.70	7.25	6.93	6.71	6.33	5.97	6.23 /	8.84
38	12.06	11.23	8.52	7.75	7.28	6.93	6.70	6.33	5.96	6.37 /	8.46
39	11.98	11.10	8.51	7.78	7.33	6.99	6.77	6.39	6.02	6.34 /	9.21
40	12.60	11.75	8.76	7.91	7.40	7.05	6.77	6.38	6.02	6.54 /	8.91
41	12.15	11.25	8.56	7.80	7.33	6.98	6.75	6.37	5.99	6.42 /	9.18
42	12.82	11.93	9.00	8.11	7.52	7.15	6.88	6.48	6.10	6.52 /	9.64
43	13.23	12.35	9.12	8.13	7.50	7.12	6.82	6.41	6.04	6.65 /	8.68
44	13.98	13.12	9.52	8.33	7.63	7.23	6.91	6.46	6.08	6.81 /	9.05
45	13.74	12.84	9.34	8.26	7.60	7.21	6.88	6.47	6.09	6.74 /	9.12
46	13.85	12.96	9.33	8.23	7.58	7.20	6.87	6.45	6.08	6.74 /	8.92
47	13.90	12.97	9.26	8.17	7.55	7.18	6.86	6.44	6.06	6.74 /	8.83
48	13.20	12.23	8.93	8.02	7.46	7.11	6.83	6.43	6.05	6.61 /	9.00
49	13.20	12.23	8.86	7.96	7.41	7.07	6.78	6.39	6.01	6.63 /	8.51
50	14.00	13.03	9.24	8.20	7.60	7.24	6.91	6.50	6.12	6.75 /	9.36
51	13.55	12.55	8.97	8.03	7.46	7.11	6.81	6.41	6.04	6.66 /	8.72

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	13.30	12.26	8.87	8.00	7.46	7.12	6.83	6.44	6.06	6.63 / 9.10
S1	12.91	12.35	9.73	8.35	7.49	7.01	6.66	6.22	5.88	5.81 / 9.06
S2	12.93	12.37	9.72	8.31	7.44	6.95	6.60	6.17	5.84	5.86 / 9.06
S3	12.94	12.39	9.79	8.39	7.52	7.02	6.67	6.23	5.89	5.90 / 9.08
S4	12.89	12.34	9.63	8.31	7.51	7.03	6.68	6.25	5.91	5.96 / 8.97
S5	12.92	12.35	9.64	8.31	7.52	7.04	6.70	6.27	5.93	5.95 / 8.94
S6	12.72	12.16	9.47	8.21	7.45	6.98	6.66	6.23	5.89	6.07 / 8.81
S7	12.79	12.23	9.60	8.30	7.47	6.99	6.67	6.24	5.90	6.06 / 8.84
S8	12.77	12.21	9.60	8.30	7.46	6.98	6.66	6.24	5.89	6.03 / 8.82
S9	12.73	12.17	9.54	8.24	7.43	6.96	6.65	6.22	5.88	6.03 / 8.78
S10	12.69	12.12	9.49	8.21	7.41	6.95	6.63	6.20	5.86	6.04 / 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。