

PSJ 予測統計値  
(平均値)

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・ブラザーズ,BNPパリバ,JPモルガン,みずほ,UBS,メリル・リンチ日本,大和SMBC,日興証券グループ											
回号	Yield Curve Scenarios ( % )									最低 / 最高 ( % )	
	-300bp	-200bp	-100bp	-50bp	0bp	50bp	100bp	200bp	300bp		
1	13.48	12.92	9.65	8.33	7.56	7.10	6.74	6.26	5.92	5.71 /	9.28
2	13.44	12.86	9.58	8.31	7.56	7.11	6.74	6.27	5.93	5.80 /	9.11
3	13.62	12.99	9.65	8.34	7.59	7.13	6.77	6.29	5.94	5.86 /	9.12
4	13.00	12.35	9.18	8.09	7.44	7.02	6.74	6.28	5.92	6.01 /	9.08
5	12.93	12.28	9.15	8.07	7.42	7.02	6.74	6.29	5.92	6.09 /	9.27
6	12.97	12.31	9.13	8.08	7.45	7.03	6.75	6.31	5.95	6.20 /	9.11
7	12.97	12.30	9.12	8.10	7.49	7.07	6.80	6.35	5.99	6.27 /	9.15
8	12.88	12.21	9.05	8.06	7.45	7.04	6.75	6.32	5.96	6.29 /	8.83
9	12.44	11.73	8.81	7.90	7.33	6.95	6.67	6.25	5.90	6.24 /	8.52
10	12.36	11.64	8.78	7.92	7.37	6.99	6.72	6.30	5.95	6.30 /	8.48
11	12.17	11.38	8.63	7.82	7.28	6.92	6.67	6.26	5.91	6.35 /	8.16
12	12.31	11.53	8.59	7.83	7.33	6.98	6.74	6.33	5.98	6.17 /	8.93
13	12.11	11.28	8.49	7.73	7.22	6.86	6.63	6.24	5.91	5.79 /	9.23
14	12.09	11.33	8.47	7.69	7.18	6.81	6.58	6.18	5.86	6.00 /	8.64
15	12.05	11.27	8.45	7.68	7.17	6.81	6.58	6.18	5.85	5.92 /	8.69
16	12.03	11.24	8.44	7.69	7.19	6.83	6.60	6.21	5.88	5.92 /	8.97
17	11.99	11.19	8.41	7.67	7.17	6.81	6.59	6.19	5.87	5.86 /	8.76
18	11.96	11.18	8.39	7.66	7.16	6.81	6.59	6.20	5.87	5.79 /	8.89
19	11.94	11.15	8.39	7.66	7.18	6.83	6.60	6.21	5.89	5.79 /	8.90
20	12.21	11.38	8.47	7.70	7.21	6.86	6.63	6.24	5.91	6.25 /	8.61
21	12.25	11.40	8.47	7.73	7.26	6.91	6.68	6.30	5.96	6.23 /	8.96
22	12.34	11.52	8.48	7.72	7.25	6.90	6.65	6.26	5.93	6.19 /	8.64
23	12.54	11.69	8.59	7.77	7.28	6.94	6.68	6.28	5.95	6.29 /	8.62
24	12.58	11.73	8.66	7.82	7.29	6.96	6.70	6.30	5.97	6.29 /	8.59
25	12.38	11.49	8.47	7.71	7.25	6.91	6.67	6.28	5.95	6.30 /	8.40
26	12.01	11.10	8.32	7.63	7.17	6.87	6.65	6.26	5.93	6.23 /	8.83
27	11.78	10.85	8.21	7.58	7.17	6.86	6.65	6.27	5.94	6.06 /	8.38
28	12.10	11.16	8.30	7.62	7.18	6.86	6.64	6.25	5.92	6.40 /	8.38
29	11.73	10.76	8.22	7.62	7.21	6.91	6.70	6.32	5.99	6.09 /	8.95
30	12.05	11.05	8.45	7.83	7.42	7.10	6.87	6.48	6.13	5.96 /	9.75
31	11.48	10.47	8.13	7.58	7.18	6.90	6.69	6.31	5.98	6.03 /	9.11
32	11.15	10.14	7.97	7.47	7.07	6.82	6.62	6.25	5.92	6.07 /	8.47
33	11.55	10.53	8.09	7.55	7.15	6.86	6.65	6.28	5.95	6.12 /	8.64
34	11.30	10.25	8.02	7.47	7.07	6.83	6.63	6.25	5.92	6.08 /	8.59
35	11.41	10.33	8.02	7.47	7.07	6.82	6.61	6.24	5.91	6.14 /	8.49
36	11.78	10.75	8.15	7.59	7.19	6.89	6.68	6.30	5.97	6.19 /	8.90
37	11.76	10.71	8.18	7.58	7.17	6.88	6.67	6.29	5.96	6.19 /	8.80
38	12.09	11.06	8.27	7.62	7.20	6.88	6.67	6.28	5.95	6.34 /	8.43
39	12.05	10.94	8.26	7.65	7.24	6.93	6.71	6.33	6.00	6.31 /	9.08
40	12.62	11.57	8.48	7.76	7.32	6.99	6.73	6.35	6.01	6.50 /	8.88
41	12.21	11.10	8.32	7.67	7.25	6.94	6.71	6.33	5.99	6.38 /	9.13
42	12.88	11.76	8.73	7.95	7.42	7.09	6.83	6.44	6.09	6.46 /	9.59
43	13.23	12.14	8.81	7.95	7.40	7.07	6.77	6.37	6.03	6.60 /	8.66
44	13.94	12.87	9.15	8.12	7.52	7.17	6.85	6.42	6.08	6.75 /	8.84
45	13.71	12.59	8.99	8.06	7.48	7.14	6.82	6.42	6.08	6.67 /	9.10
46	13.83	12.72	8.99	8.04	7.48	7.15	6.82	6.41	6.07	6.71 /	8.93
47	13.88	12.71	8.92	7.99	7.47	7.13	6.80	6.39	6.05	6.71 /	8.64
48	13.23	12.01	8.65	7.86	7.38	7.06	6.78	6.39	6.05	6.58 /	8.96
49	13.22	11.99	8.58	7.80	7.34	7.02	6.73	6.34	6.00	6.60 /	8.48
50	13.98	12.76	8.90	8.02	7.52	7.18	6.85	6.45	6.11	6.75 /	9.35
51	13.56	12.29	8.69	7.88	7.38	7.09	6.80	6.41	6.07	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・ブローカーズ、BNPパリバ、JPモルガン、みずほ、UBS、メリル・リンチ日本、大和SMBC、日興フィナンシャルグループ

回号	Yield Curve Scenarios ( % )									最低 / 最高 ( % )
	-300bp	-200bp	-100bp	-50bp	0bp	50bp	100bp	200bp	300bp	
S1	12.87	12.20	9.30	8.09	7.37	6.96	6.62	6.18	5.86	5.76 / 8.91
S2	12.89	12.24	9.34	8.12	7.39	6.97	6.63	6.20	5.87	5.87 / 8.91
S3	13.47	12.83	9.61	8.31	7.57	7.13	6.77	6.30	5.96	5.87 / 9.41
S4	12.84	12.18	9.21	8.06	7.39	6.97	6.65	6.21	5.89	5.93 / 8.87
S5	12.83	12.17	9.20	8.06	7.39	6.97	6.65	6.22	5.89	5.88 / 8.76
S6	12.73	12.07	9.19	8.05	7.34	6.93	6.63	6.20	5.87	6.03 / 8.83
S7	12.73	12.07	9.19	8.05	7.34	6.93	6.62	6.20	5.86	5.97 / 8.82
S8	12.68	12.02	9.15	8.01	7.32	6.92	6.61	6.19	5.86	6.00 / 8.82
S9	12.64	11.97	9.09	7.97	7.30	6.89	6.59	6.17	5.84	5.99 / 8.78
S10	12.60	11.94	9.05	7.95	7.29	6.88	6.58	6.16	5.84	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。