

PSJ 予測統計値
(中央値)

2007年 4月 16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	11.91	11.91	9.61	8.69	7.95	7.12	6.83	6.33	6.05	5.55 /	8.87
2	11.83	11.77	9.23	8.64	7.94	7.08	6.80	6.40	5.98	5.63 /	8.88
3	12.02	12.02	9.23	8.72	8.00	7.06	6.79	6.50	6.12	5.71 /	8.99
4	11.53	11.52	9.20	8.63	7.57	6.93	6.79	6.46	6.04	5.87 /	8.72
5	12.26	11.04	9.21	8.58	7.50	6.89	6.77	6.30	5.88	5.97 /	8.69
6	11.74	11.57	9.29	8.48	7.57	6.89	6.80	6.34	5.92	6.10 /	8.65
7	11.70	11.70	8.98	8.47	7.49	7.07	6.80	6.68	6.44	6.15 /	8.91
8	11.74	11.24	9.22	8.58	7.53	7.00	6.76	6.71	6.38	6.18 /	8.92
9	11.44	11.28	8.96	8.21	7.48	7.04	6.70	6.30	5.90	6.13 /	8.87
10	11.22	11.22	9.28	8.40	7.40	7.09	6.81	6.71	6.44	6.18 /	8.79
11	11.36	11.04	9.09	8.26	7.27	6.99	6.70	6.67	6.27	6.02 /	8.69
12	11.25	10.66	8.86	8.05	7.35	6.89	6.96	6.69	6.44	5.99 /	8.71
13	10.94	10.89	8.96	8.45	7.46	6.92	6.89	6.62	6.37	6.36 /	8.91
14	11.26	11.26	9.05	8.19	7.31	6.96	6.89	6.62	6.37	6.33 /	8.45
15	10.99	10.90	8.97	8.14	7.26	6.92	6.89	6.65	6.40	6.38 /	8.49
16	10.96	10.85	8.93	8.09	7.37	6.89	6.91	6.65	6.40	6.39 /	8.76
17	11.23	10.85	8.93	8.10	7.32	6.87	6.92	6.65	6.40	6.40 /	8.46
18	11.23	10.79	8.89	8.06	7.40	6.86	6.90	6.64	6.38	6.37 /	8.60
19	11.45	10.74	8.83	8.20	7.39	6.84	6.96	6.68	6.42	6.41 /	8.62
20	11.73	11.05	9.02	7.98	7.33	6.80	6.93	6.73	6.47	6.43 /	8.49
21	11.67	10.95	9.05	7.97	7.43	6.77	7.08	6.82	6.56	6.47 /	8.79
22	11.98	11.12	8.82	8.02	7.37	6.94	6.90	6.80	6.53	6.50 /	8.56
23	12.00	11.15	9.16	7.98	7.42	6.89	6.84	6.83	6.58	6.52 /	8.63
24	11.92	11.01	9.16	7.97	7.49	6.86	6.82	6.80	6.63	6.53 /	8.63
25	11.30	10.83	8.99	7.86	7.53	6.83	6.74	6.74	6.63	6.52 /	8.61
26	11.65	10.51	8.95	7.69	7.35	6.66	6.99	6.77	6.51	6.41 /	8.58
27	10.79	9.57	8.76	7.77	7.40	6.90	6.93	6.81	6.59	6.43 /	8.59
28	11.61	10.47	8.72	7.66	7.45	6.80	6.79	6.77	6.66	6.46 /	8.55
29	10.80	9.91	8.69	7.83	7.38	6.91	6.92	6.78	6.51	6.43 /	8.81
30	10.50	9.89	8.52	7.84	7.35	6.94	6.90	6.76	6.69	6.43 /	9.61
31	10.44	9.78	8.50	7.78	7.31	6.88	6.87	6.74	6.64	6.40 /	8.99
32	10.36	9.59	8.28	7.70	7.27	6.87	6.85	6.75	6.68	6.37 /	8.48
33	10.61	9.86	8.44	7.79	7.32	6.89	6.86	6.73	6.50	6.44 /	8.61
34	10.37	9.39	8.12	7.68	7.23	6.91	6.84	6.72	6.67	6.36 /	8.57
35	10.49	9.61	7.97	7.74	7.22	6.85	6.69	6.69	6.65	6.36 /	8.48
36	10.84	9.97	8.61	7.80	7.32	6.82	6.83	6.70	6.65	6.46 /	8.77
37	10.77	9.85	8.29	7.79	7.25	6.86	6.81	6.69	6.59	6.44 /	8.68
38	11.12	10.14	8.33	7.83	7.46	6.83	6.69	6.68	6.64	6.49 /	8.58
39	10.94	9.97	8.59	7.77	7.38	6.96	6.81	6.68	6.63	6.46 /	9.02
40	11.74	10.47	8.95	7.84	7.59	6.96	6.85	6.69	6.63	6.56 /	8.81
41	11.07	10.05	8.08	7.85	7.51	6.81	6.58	6.44	6.44	6.49 /	9.00
42	11.65	10.30	8.89	7.88	7.58	7.03	6.93	6.67	6.62	6.55 /	9.45
43	11.91	10.81	8.79	7.92	7.67	7.03	6.84	6.65	6.62	6.65 /	8.71
44	12.86	12.00	9.41	8.06	7.80	7.11	6.88	6.59	6.59	6.77 /	8.86
45	12.21	11.59	9.10	7.96	7.75	7.04	6.85	6.63	6.61	6.69 /	8.90
46	12.45	11.76	9.15	7.99	7.75	7.07	6.86	6.63	6.62	6.72 /	8.80
47	12.54	11.85	8.98	8.06	7.76	7.03	6.78	6.54	6.54	6.72 /	8.82
48	12.22	10.73	8.63	7.95	7.67	6.98	6.81	6.68	6.63	6.59 /	8.83
49	12.27	10.63	8.38	7.98	7.70	6.96	6.76	6.58	6.58	6.60 /	8.72
50	12.79	11.82	9.27	8.04	7.81	7.12	6.85	6.70	6.63	6.71 /	9.12
51	12.54	11.12	8.56	7.98	7.76	7.02	6.80	6.63	6.63	6.64 /	8.78

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、日興フィグループ

回号	Yield Curve Scenarios (%)									最低 / 最高 (%)
	-300bp	-200bp	-100bp	-50bp	0bp	50bp	100bp	200bp	300bp	
52	12.24	10.71	8.66	8.00	7.72	7.03	6.81	6.69	6.65	6.59 / 8.90
53	11.98	11.11	8.87	8.07	7.77	7.15	6.90	6.72	6.67	6.64 / 9.20
S1	12.29	12.09	9.62	8.44	7.97	7.29	6.72	6.32	6.10	5.64 / 8.90
S2	12.11	12.07	9.68	8.43	7.96	7.32	6.76	6.31	5.93	5.68 / 8.89
S3	12.29	12.18	9.64	8.47	8.01	7.29	6.71	6.34	5.92	5.70 / 8.90
S4	12.10	12.10	9.48	8.59	7.95	7.35	6.83	6.52	6.15	5.80 / 8.79
S5	12.73	12.12	9.24	8.65	7.93	7.33	6.83	6.51	6.18	5.77 / 8.76
S6	11.75	11.67	9.48	8.36	7.88	7.29	6.81	6.48	6.06	5.90 / 8.63
S7	11.71	11.66	9.47	8.47	7.82	7.30	6.81	6.51	6.09	5.88 / 8.64
S8	11.75	11.65	9.47	8.54	7.85	7.29	6.78	6.54	6.11	5.86 / 8.63
S9	11.68	11.60	9.45	8.29	7.76	7.29	6.78	6.51	6.11	5.86 / 8.62
S10	11.70	11.59	9.45	8.20	7.80	7.28	6.80	6.53	6.11	5.88 / 8.62

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。