

PSJ 予測統計値
(平均値)

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	13.14	12.58	9.64	8.42	7.62	7.10	6.74	6.28	5.92	5.55 /	8.87
2	13.13	12.55	9.55	8.34	7.60	7.12	6.79	6.25	5.93	5.63 /	8.88
3	13.28	12.69	9.63	8.41	7.65	7.15	6.76	6.32	5.95	5.71 /	8.99
4	12.67	12.08	9.21	8.21	7.51	7.04	6.75	6.28	5.92	5.87 /	8.72
5	12.59	11.95	9.16	8.16	7.48	7.02	6.76	6.29	5.95	5.97 /	8.69
6	12.65	12.03	9.19	8.15	7.51	7.06	6.80	6.31	6.01	6.10 /	8.65
7	12.59	11.93	9.14	8.18	7.56	7.13	6.84	6.37	6.02	6.15 /	8.91
8	12.56	11.92	9.16	8.18	7.53	7.12	6.84	6.38	6.03	6.18 /	8.92
9	12.13	11.45	8.93	8.07	7.43	6.99	6.71	6.33	5.97	6.13 /	8.87
10	12.03	11.38	8.95	8.06	7.45	7.04	6.76	6.37	5.99	6.18 /	8.79
11	12.00	11.30	8.82	7.99	7.37	6.93	6.73	6.30	5.93	6.02 /	8.69
12	11.95	11.19	8.72	7.95	7.35	7.00	6.78	6.38	6.00	5.99 /	8.71
13	12.14	11.45	8.89	8.04	7.43	7.02	6.79	6.40	6.09	6.36 /	8.91
14	12.19	11.48	8.87	8.03	7.41	7.02	6.79	6.37	5.99	6.33 /	8.45
15	12.15	11.45	8.83	8.02	7.42	6.98	6.80	6.38	6.00	6.38 /	8.49
16	12.13	11.41	8.82	8.03	7.43	7.02	6.85	6.43	6.06	6.39 /	8.76
17	12.09	11.34	8.81	8.01	7.40	7.00	6.83	6.36	6.07	6.40 /	8.46
18	12.12	11.31	8.75	7.93	7.38	7.02	6.78	6.40	6.04	6.37 /	8.60
19	12.14	11.24	8.75	8.00	7.41	6.98	6.83	6.42	6.06	6.41 /	8.62
20	12.14	11.37	8.79	7.98	7.39	7.04	6.83	6.39	6.09	6.43 /	8.49
21	12.23	11.44	8.79	8.03	7.46	7.06	6.90	6.46	6.16	6.47 /	8.79
22	12.31	11.54	8.77	8.00	7.45	7.06	6.86	6.43	6.11	6.50 /	8.56
23	12.47	11.65	8.89	8.03	7.47	7.12	6.90	6.49	6.12	6.52 /	8.63
24	12.57	11.74	8.94	8.10	7.49	7.11	6.92	6.47	6.17	6.53 /	8.63
25	12.32	11.46	8.76	7.97	7.43	7.09	6.85	6.48	6.11	6.52 /	8.61
26	11.98	11.05	8.64	7.88	7.35	7.00	6.84	6.44	6.10	6.41 /	8.58
27	11.72	10.78	8.54	7.82	7.35	7.00	6.86	6.49	6.12	6.43 /	8.59
28	12.08	11.18	8.62	7.91	7.37	7.06	6.85	6.48	6.15	6.46 /	8.55
29	11.64	10.68	8.50	7.87	7.38	7.07	6.88	6.52	6.16	6.43 /	8.81
30	11.59	10.65	8.57	7.91	7.48	7.18	7.03	6.60	6.28	6.43 /	9.61
31	11.40	10.42	8.44	7.80	7.35	7.08	6.91	6.49	6.17	6.40 /	8.99
32	11.08	10.06	8.23	7.65	7.24	6.97	6.84	6.45	6.13	6.37 /	8.48
33	11.50	10.47	8.37	7.79	7.34	7.03	6.89	6.52	6.14	6.44 /	8.61
34	11.19	10.16	8.32	7.73	7.26	7.04	6.89	6.51	6.16	6.36 /	8.57
35	11.29	10.28	8.29	7.70	7.25	6.98	6.83	6.43	6.13	6.36 /	8.48
36	11.68	10.72	8.44	7.83	7.38	7.05	6.89	6.52	6.21	6.46 /	8.77
37	11.68	10.65	8.47	7.85	7.36	7.04	6.94	6.49	6.16	6.44 /	8.68
38	12.08	11.08	8.59	7.88	7.40	7.06	6.91	6.52	6.19	6.49 /	8.58
39	11.94	10.89	8.56	7.91	7.44	7.11	6.99	6.59	6.22	6.46 /	9.02
40	12.57	11.51	8.80	8.02	7.54	7.21	7.00	6.58	6.27	6.56 /	8.81
41	12.12	11.03	8.60	7.94	7.45	7.12	6.97	6.54	6.24	6.49 /	9.00
42	12.76	11.64	9.04	8.26	7.64	7.32	7.06	6.71	6.34	6.55 /	9.45
43	13.16	12.08	9.11	8.23	7.63	7.24	7.01	6.65	6.26	6.65 /	8.71
44	13.91	12.82	9.42	8.41	7.77	7.39	7.14	6.68	6.32	6.77 /	8.86
45	13.65	12.56	9.33	8.37	7.75	7.35	7.08	6.70	6.34	6.69 /	8.90
46	13.80	12.69	9.38	8.41	7.75	7.40	7.14	6.71	6.36	6.72 /	8.80
47	13.82	12.71	9.23	8.30	7.72	7.37	7.08	6.68	6.31	6.72 /	8.82
48	13.23	12.05	9.06	8.22	7.64	7.30	7.10	6.67	6.31	6.59 /	8.83
49	13.25	12.02	8.97	8.15	7.58	7.25	7.03	6.64	6.26	6.60 /	8.72
50	14.01	12.82	9.29	8.37	7.79	7.41	7.19	6.77	6.39	6.71 /	9.12
51	13.60	12.36	9.09	8.19	7.64	7.32	7.08	6.69	6.31	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	13.37	12.11	9.01	8.19	7.66	7.33	7.13	6.70	6.39	6.59 / 8.90
53	13.65	12.39	9.17	8.31	7.74	7.38	7.19	6.76	6.39	6.64 / 9.20
S1	13.03	12.41	9.55	8.37	7.62	7.16	6.78	6.35	5.96	5.64 / 8.90
S2	13.02	12.38	9.61	8.43	7.61	7.16	6.81	6.30	5.99	5.68 / 8.89
S3	13.07	12.44	9.59	8.38	7.62	7.17	6.79	6.32	5.96	5.70 / 8.90
S4	12.99	12.40	9.52	8.39	7.64	7.14	6.86	6.32	6.01	5.80 / 8.79
S5	13.04	12.37	9.50	8.38	7.65	7.17	6.82	6.37	5.99	5.77 / 8.76
S6	12.93	12.30	9.51	8.36	7.60	7.17	6.84	6.34	5.98	5.90 / 8.63
S7	12.91	12.27	9.53	8.37	7.61	7.15	6.80	6.33	5.96	5.88 / 8.64
S8	12.89	12.25	9.49	8.35	7.58	7.13	6.78	6.33	5.96	5.86 / 8.63
S9	12.84	12.18	9.41	8.29	7.55	7.13	6.78	6.27	5.99	5.86 / 8.62
S10	12.80	12.17	9.38	8.24	7.54	7.11	6.74	6.31	5.94	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。