

PSJ 予測統計値
(中央値)

2007年 5月 15日 公表

貸付債権担保住宅金融支援機構債券 / 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・スタール,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・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			
JHF-1	13.40	12.47	10.18	9.40	9.13	8.30	8.15	8.14	7.72	7.71 / 10.21		
GHLC-1	12.47	12.47	9.84	9.04	8.09	7.30	6.89	6.37	6.08	5.44 / 9.26		
GHLC-2	12.59	12.59	9.89	8.82	7.88	7.28	6.91	6.31	6.22	5.52 / 9.24		
GHLC-3	13.03	12.83	10.00	8.99	7.95	7.29	6.98	6.45	6.31	5.59 / 9.32		
GHLC-4	11.47	11.47	9.55	8.90	7.85	7.26	6.79	6.38	6.38	5.76 / 8.98		
GHLC-5	12.24	11.00	9.45	8.73	7.82	7.20	6.77	6.48	6.48	5.87 / 8.94		
GHLC-6	11.96	11.53	9.42	8.68	7.87	7.24	6.78	6.60	6.52	6.00 / 8.94		
GHLC-7	12.27	11.98	9.44	8.56	7.82	7.20	6.81	6.71	6.68	6.04 / 8.88		
GHLC-8	12.00	11.95	9.44	8.78	7.84	7.16	6.77	6.75	6.48	6.06 / 8.86		
GHLC-9	11.74	11.74	9.20	8.49	7.47	7.02	6.71	6.55	6.47	6.03 / 8.81		
GHLC-10	12.06	11.76	9.45	8.40	7.59	7.11	6.85	6.79	6.50	6.12 / 8.74		
GHLC-11	11.70	11.51	9.12	8.26	7.54	6.99	6.91	6.68	6.45	6.13 / 8.63		
GHLC-12	11.80	11.08	8.86	8.05	7.32	7.12	6.99	6.83	6.81	6.27 / 8.55		
GHLC-13	12.23	11.28	9.03	8.45	7.59	7.04	6.94	6.83	6.39	6.34 / 8.75		
GHLC-14	11.84	11.40	8.83	8.19	7.45	6.97	6.92	6.83	6.53	6.23 / 8.38		
GHLC-15	11.80	11.31	8.96	8.14	7.46	6.98	6.95	6.82	6.69	6.26 / 8.42		
GHLC-16	12.16	11.24	9.21	8.38	7.44	7.06	6.96	6.80	6.73	6.32 / 8.61		
GHLC-17	12.09	11.22	9.03	8.14	7.43	7.05	6.98	6.81	6.77	6.31 / 8.41		
GHLC-18	11.83	11.18	8.89	8.21	7.41	7.07	6.97	6.81	6.55	6.27 / 8.51		
GHLC-19	11.86	11.14	9.23	8.19	7.38	7.09	6.96	6.81	6.77	6.38 / 8.48		
GHLC-20	11.72	11.05	9.18	8.07	7.33	7.14	6.93	6.79	6.63	6.38 / 8.43		
GHLC-21	11.66	10.95	9.00	8.08	7.42	7.19	7.11	6.85	6.73	6.53 / 8.76		
GHLC-22	11.96	11.12	9.30	8.05	7.38	7.13	6.94	6.81	6.73	6.53 / 8.75		
GHLC-23	11.98	11.15	9.06	8.03	7.41	7.16	6.95	6.84	6.71	6.54 / 9.88		
GHLC-24	11.76	11.02	9.07	7.98	7.47	7.14	6.93	6.81	6.63	6.57 / 9.13		
GHLC-25	11.65	10.84	8.95	7.87	7.47	7.12	6.91	6.74	6.58	6.59 / 8.83		
GHLC-26	11.32	10.52	8.88	7.71	7.27	7.06	6.88	6.75	6.51	6.50 / 8.73		
GHLC-27	10.89	9.88	8.77	7.75	7.36	7.03	6.93	6.92	6.76	6.53 / 8.58		
GHLC-28	11.32	10.42	8.76	7.67	7.34	7.03	6.85	6.78	6.67	6.54 / 8.63		
GHLC-29	10.79	9.63	8.71	7.79	7.32	7.20	7.18	7.07	6.64	6.45 / 8.78		
GHLC-30	10.46	9.84	8.56	7.78	7.31	7.13	7.12	7.10	6.61	6.25 / 9.46		
GHLC-31	10.41	9.62	8.50	7.73	7.35	7.15	7.14	7.07	6.73	5.84 / 8.85		
GHLC-32	10.31	9.60	8.25	7.55	7.18	6.98	6.97	6.93	6.62	5.32 / 8.43		
GHLC-33	10.57	9.91	8.42	7.72	7.25	6.96	6.92	6.87	6.80	6.18 / 8.50		
GHLC-34	10.34	9.48	8.09	7.57	7.15	6.91	6.90	6.90	6.77	5.60 / 8.79		
GHLC-35	10.47	9.66	7.95	7.61	7.15	6.89	6.76	6.69	6.69	5.74 / 8.70		
GHLC-36	10.83	9.98	8.57	7.72	7.20	7.02	6.98	6.97	6.77	6.47 / 8.69		
GHLC-37	10.74	9.87	8.27	7.65	7.18	6.89	6.84	6.83	6.57	6.45 / 8.64		
GHLC-38	11.09	10.04	8.31	7.76	7.22	6.92	6.76	6.68	6.68	6.51 / 8.62		
GHLC-39	10.91	10.00	8.54	7.69	7.19	7.02	7.02	7.02	6.79	6.49 / 8.89		
GHLC-40	11.61	10.30	8.90	7.74	7.57	6.96	6.92	6.92	6.73	6.61 / 8.66		
GHLC-41	11.06	10.07	8.12	7.71	7.20	6.91	6.75	6.63	6.57	6.52 / 8.95		
GHLC-42	11.56	10.45	8.84	7.83	7.56	7.08	7.05	7.04	6.80	6.58 / 9.30		
GHLC-43	11.84	10.85	8.80	7.86	7.62	7.03	6.79	6.65	6.64	6.68 / 9.28		
GHLC-44	12.85	11.94	9.41	8.07	7.67	7.47	6.84	6.58	6.58	6.84 / 9.61		
GHLC-45	12.19	11.51	9.11	7.92	7.65	7.44	6.80	6.62	6.57	6.75 / 9.66		
GHLC-46	12.43	11.71	9.17	7.97	7.70	7.43	6.81	6.65	6.62	6.78 / 9.95		
GHLC-47	12.69	11.78	9.01	8.04	7.73	7.46	6.81	6.65	6.59	6.79 / 9.65		
GHLC-48	12.17	10.79	8.65	7.85	7.67	6.96	6.76	6.64	6.57	6.62 / 9.11		
GHLC-49	12.21	10.62	8.42	7.82	7.69	6.97	6.76	6.63	6.57	6.64 / 8.75		
GHLC-50	12.56	11.88	9.30	8.00	7.74	7.51	6.83	6.83	6.83	6.80 / 9.85		

貸付債権担保住宅金融支援機構債券 / 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、日興証券グループ

回号	Yield Curve Scenarios (%)									最低 / 最高 (%)	
	-300bp	-200bp	-100bp	-50bp	0bp	50bp	100bp	200bp	300bp		
GHLC-S1	12.53	11.12	8.57	7.90	7.75	7.46	6.78	6.66	6.62	6.71 /	9.45
GHLC-S2	12.22	10.74	8.67	7.84	7.72	6.93	6.87	6.86	6.86	6.71 /	9.28
GHLC-S3	12.51	11.10	8.92	7.87	7.77	7.25	6.96	6.95	6.95	6.75 /	9.56
JHF-S1	11.62	11.53	9.32	8.47	7.76	7.19	6.69	6.50	6.01	5.96 /	9.73
GHLC-S1	12.14	11.98	9.75	8.89	7.92	7.27	6.82	6.39	6.09	5.52 /	9.43
GHLC-S2	12.04	12.00	9.72	8.66	8.05	7.32	6.82	6.39	6.09	5.56 /	9.69
GHLC-S3	12.21	12.08	9.91	8.90	8.03	7.33	6.83	6.24	6.14	5.60 /	9.70
GHLC-S4	12.07	11.99	9.72	9.02	8.02	7.38	6.79	6.48	6.29	5.69 /	9.83
GHLC-S5	12.82	12.02	9.89	9.00	7.97	7.36	6.81	6.51	6.27	5.66 /	9.84
GHLC-S6	11.69	11.61	9.42	8.55	7.85	7.27	6.78	6.39	6.37	5.80 /	9.88
GHLC-S7	11.69	11.61	9.45	8.58	7.82	7.28	6.77	6.42	6.39	5.78 /	9.88
GHLC-S8	11.68	11.58	9.42	8.92	7.82	7.25	6.76	6.46	6.36	5.78 /	9.90
GHLC-S9	11.63	11.52	9.42	8.61	7.74	7.27	6.77	6.46	6.36	5.76 /	10.18
GHLC-S10	11.65	11.57	9.41	8.54	7.84	7.38	6.76	6.46	6.37	5.78 /	9.90

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。