

PSJ 予測統計値
(平均値)

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・スチュワート,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		
JHF-1	14.80	13.46	10.39	9.55	8.97	8.64	8.28	8.01	7.63	7.71 / 10.21	
GHLC-1	13.34	12.77	9.97	8.67	7.76	7.21	6.86	6.35	6.08	5.44 / 9.26	
GHLC-2	13.20	12.58	9.74	8.46	7.66	7.18	6.82	6.37	6.09	5.52 / 9.24	
GHLC-3	13.33	12.74	9.85	8.59	7.71	7.26	6.91	6.41	6.14	5.59 / 9.32	
GHLC-4	12.84	12.28	9.44	8.35	7.58	7.14	6.82	6.40	6.15	5.76 / 8.98	
GHLC-5	12.72	12.04	9.30	8.26	7.54	7.17	6.89	6.44	6.12	5.87 / 8.94	
GHLC-6	12.86	12.18	9.38	8.32	7.60	7.14	6.92	6.45	6.20	6.00 / 8.94	
GHLC-7	12.90	12.21	9.39	8.34	7.62	7.19	6.92	6.48	6.14	6.04 / 8.88	
GHLC-8	12.85	12.14	9.33	8.31	7.60	7.20	6.91	6.43	6.19	6.06 / 8.86	
GHLC-9	12.36	11.72	9.11	8.12	7.46	7.09	6.78	6.40	6.06	6.03 / 8.81	
GHLC-10	12.23	11.57	9.08	8.14	7.49	7.08	6.88	6.42	6.18	6.12 / 8.74	
GHLC-11	12.13	11.39	8.86	8.00	7.40	7.00	6.78	6.41	6.13	6.13 / 8.63	
GHLC-12	12.02	11.25	8.71	7.92	7.37	7.02	6.86	6.44	6.18	6.27 / 8.55	
GHLC-13	12.30	11.58	8.99	8.09	7.45	7.08	6.86	6.48	6.17	6.34 / 8.75	
GHLC-14	12.21	11.49	8.78	8.01	7.39	7.04	6.82	6.42	6.14	6.23 / 8.38	
GHLC-15	12.19	11.44	8.81	7.98	7.41	7.05	6.80	6.43	6.16	6.26 / 8.42	
GHLC-16	12.25	11.55	8.95	8.07	7.43	7.11	6.87	6.48	6.19	6.32 / 8.61	
GHLC-17	12.33	11.59	8.97	8.02	7.42	7.06	6.83	6.49	6.19	6.31 / 8.41	
GHLC-18	12.47	11.71	8.99	8.13	7.45	7.07	6.88	6.50	6.17	6.27 / 8.51	
GHLC-19	12.48	11.67	9.04	8.12	7.47	7.08	6.86	6.48	6.24	6.38 / 8.48	
GHLC-20	12.35	11.57	8.97	8.11	7.44	7.11	6.86	6.48	6.20	6.38 / 8.43	
GHLC-21	12.55	11.68	9.06	8.20	7.53	7.19	6.96	6.61	6.29	6.53 / 8.76	
GHLC-22	12.69	11.85	9.11	8.19	7.52	7.11	6.93	6.53	6.28	6.53 / 8.75	
GHLC-23	12.84	11.99	9.21	8.33	7.63	7.17	6.91	6.58	6.27	6.54 / 9.88	
GHLC-24	12.78	11.92	9.11	8.28	7.55	7.15	6.92	6.58	6.24	6.57 / 9.13	
GHLC-25	12.59	11.72	8.96	8.12	7.49	7.11	6.93	6.57	6.24	6.59 / 8.83	
GHLC-26	12.10	11.23	8.87	8.03	7.40	7.03	6.84	6.46	6.21	6.50 / 8.73	
GHLC-27	11.91	10.96	8.69	7.95	7.34	7.05	6.83	6.59	6.28	6.53 / 8.58	
GHLC-28	12.25	11.35	8.84	8.05	7.41	7.10	6.87	6.55	6.25	6.54 / 8.63	
GHLC-29	11.87	10.89	8.76	7.98	7.40	7.09	6.89	6.65	6.32	6.45 / 8.78	
GHLC-30	11.73	10.76	8.77	8.00	7.43	7.14	6.99	6.70	6.39	6.25 / 9.46	
GHLC-31	11.44	10.50	8.58	7.84	7.31	7.09	6.90	6.64	6.32	5.84 / 8.85	
GHLC-32	11.13	10.21	8.43	7.70	7.18	6.98	6.83	6.53	6.26	5.32 / 8.43	
GHLC-33	11.59	10.63	8.56	7.83	7.30	7.07	6.87	6.56	6.31	6.18 / 8.50	
GHLC-34	11.32	10.34	8.46	7.78	7.24	7.00	6.88	6.57	6.30	5.60 / 8.79	
GHLC-35	11.45	10.44	8.50	7.83	7.25	7.01	6.85	6.54	6.29	5.74 / 8.70	
GHLC-36	11.96	10.96	8.73	7.98	7.39	7.11	6.91	6.64	6.37	6.47 / 8.69	
GHLC-37	11.82	10.80	8.63	7.95	7.35	7.07	6.85	6.57	6.27	6.45 / 8.64	
GHLC-38	12.23	11.19	8.74	8.03	7.40	7.07	6.86	6.56	6.27	6.51 / 8.62	
GHLC-39	12.16	11.05	8.80	8.09	7.45	7.11	6.92	6.66	6.35	6.49 / 8.89	
GHLC-40	12.68	11.63	8.92	8.15	7.54	7.18	6.94	6.64	6.38	6.61 / 8.66	
GHLC-41	12.23	11.10	8.74	8.05	7.44	7.11	6.91	6.66	6.37	6.52 / 8.95	
GHLC-42	12.80	11.73	9.04	8.27	7.61	7.24	7.02	6.74	6.47	6.58 / 9.30	
GHLC-43	13.29	12.25	9.21	8.38	7.65	7.31	7.00	6.70	6.37	6.68 / 9.28	
GHLC-44	13.97	12.92	9.57	8.58	7.84	7.42	7.01	6.70	6.37	6.84 / 9.61	
GHLC-45	13.74	12.67	9.42	8.49	7.81	7.39	7.04	6.69	6.40	6.75 / 9.66	
GHLC-46	13.94	12.87	9.50	8.58	7.85	7.41	7.05	6.73	6.40	6.78 / 9.95	
GHLC-47	14.06	12.93	9.47	8.56	7.83	7.42	7.09	6.74	6.42	6.79 / 9.65	
GHLC-48	13.28	12.09	9.16	8.35	7.67	7.31	6.97	6.66	6.37	6.62 / 9.11	
GHLC-49	13.33	12.10	9.05	8.30	7.61	7.28	6.95	6.66	6.39	6.64 / 8.75	
GHLC-50	14.25	13.08	9.61	8.62	7.91	7.52	7.18	6.85	6.52	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、日興フィグループ

回号	Yield Curve Scenarios (%)									最低 / 最高(%)
	-300bp	-200bp	-100bp	-50bp	0bp	50bp	100bp	200bp	300bp	
GHLC-51	13.83	12.60	9.30	8.47	7.74	7.37	7.10	6.76	6.45	6.71 / 9.45
GHLC-52	13.61	12.35	9.27	8.45	7.74	7.40	7.14	6.82	6.55	6.71 / 9.28
GHLC-53	14.00	12.72	9.44	8.61	7.88	7.48	7.17	6.88	6.58	6.75 / 9.56
JHF-S1	12.81	12.11	9.39	8.36	7.63	7.21	6.90	6.49	6.15	5.96 / 9.73
GHLC-S1	13.14	12.51	9.74	8.55	7.70	7.24	6.92	6.39	6.14	5.52 / 9.43
GHLC-S2	13.11	12.55	9.70	8.53	7.72	7.25	6.90	6.44	6.14	5.56 / 9.69
GHLC-S3	13.05	12.47	9.72	8.54	7.72	7.29	6.95	6.44	6.14	5.60 / 9.70
GHLC-S4	13.09	12.43	9.63	8.56	7.75	7.27	6.98	6.48	6.20	5.69 / 9.83
GHLC-S5	13.12	12.50	9.65	8.57	7.76	7.31	6.97	6.52	6.24	5.66 / 9.84
GHLC-S6	12.89	12.28	9.53	8.44	7.68	7.27	6.91	6.48	6.17	5.80 / 9.88
GHLC-S7	12.94	12.28	9.55	8.45	7.68	7.26	6.90	6.47	6.22	5.78 / 9.88
GHLC-S8	12.88	12.31	9.53	8.48	7.68	7.25	6.93	6.49	6.20	5.78 / 9.90
GHLC-S9	12.94	12.28	9.57	8.47	7.69	7.24	6.95	6.52	6.20	5.76 / 10.18
GHLC-S10	12.94	12.29	9.51	8.46	7.68	7.22	6.96	6.52	6.22	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。