

PSJ 予測統計値
(平均値)

2007年 7月 2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,モルガン`スタンレー,クレディ`スイス,ド`イツ,リーマン`ブラ`ザー`ズ ,BNPパ`リバ` , JPモルガ`ン,ヘ`アー`スターンズ` ,みずほ,UBS,メリル`リンチ`日本,大和SMBC,日興シ`ェイク`グループ												
回号	Yield Curve Scenarios (%)										最低 / 最高(%)	
	-300bp	-200bp	-100bp	-50bp	0bp	50bp	100bp	200bp	300bp			
JHF-1	16.01	14.23	10.44	9.54	8.88	8.44	8.04	7.55	7.18	7.72 / 10.15		
JHF-2	15.91	14.13	10.43	9.53	8.86	8.41	8.02	7.52	7.14	7.73 / 10.09		
JHF-3	15.89	14.06	10.44	9.65	8.88	8.47	8.07	7.59	7.21	7.64 / 10.15		
GHLC-1	13.56	12.96	9.54	8.32	7.46	6.87	6.45	5.83	5.46	5.19 / 9.02		
GHLC-2	13.44	12.72	9.34	8.17	7.42	6.88	6.47	5.87	5.50	5.29 / 9.15		
GHLC-3	13.52	12.87	9.44	8.19	7.46	6.92	6.50	5.90	5.52	5.37 / 9.21		
GHLC-4	13.11	12.29	9.06	7.99	7.31	6.85	6.49	5.93	5.56	5.57 / 9.00		
GHLC-5	12.90	12.08	8.98	7.93	7.27	6.83	6.48	5.91	5.55	5.69 / 8.98		
GHLC-6	13.04	12.24	9.05	7.99	7.34	6.87	6.53	5.96	5.59	5.80 / 8.96		
GHLC-7	13.08	12.25	9.10	8.01	7.37	6.91	6.56	6.00	5.63	5.88 / 8.86		
GHLC-8	13.08	12.19	9.03	8.00	7.36	6.89	6.54	5.99	5.62	5.91 / 8.86		
GHLC-9	12.65	11.77	8.83	7.83	7.25	6.80	6.47	5.94	5.58	5.86 / 8.78		
GHLC-10	12.51	11.60	8.79	7.80	7.27	6.82	6.51	5.97	5.62	5.97 / 8.69		
GHLC-11	12.39	11.47	8.63	7.73	7.20	6.77	6.46	5.95	5.59	5.98 / 8.54		
GHLC-12	12.26	11.22	8.47	7.69	7.16	6.77	6.48	6.00	5.65	6.12 / 8.56		
GHLC-13	12.54	11.55	8.73	7.81	7.24	6.83	6.53	6.03	5.68	6.16 / 8.85		
GHLC-14	12.49	11.45	8.62	7.76	7.18	6.77	6.47	5.98	5.63	6.07 / 8.27		
GHLC-15	12.42	11.45	8.56	7.75	7.19	6.78	6.48	5.99	5.64	6.12 / 8.32		
GHLC-16	12.51	11.50	8.67	7.74	7.21	6.80	6.51	6.01	5.66	6.17 / 8.62		
GHLC-17	12.61	11.55	8.72	7.80	7.21	6.80	6.50	6.01	5.66	6.17 / 8.41		
GHLC-18	12.70	11.71	8.78	7.79	7.23	6.81	6.51	6.02	5.67	6.12 / 8.55		
GHLC-19	12.72	11.63	8.77	7.84	7.23	6.83	6.52	6.04	5.70	6.23 / 8.58		
GHLC-20	12.64	11.50	8.70	7.75	7.20	6.81	6.51	6.02	5.68	6.24 / 8.31		
GHLC-21	12.76	11.63	8.81	7.85	7.29	6.87	6.57	6.10	5.75	6.39 / 8.64		
GHLC-22	12.89	11.79	8.83	7.87	7.28	6.85	6.55	6.06	5.72	6.39 / 8.35		
GHLC-23	13.07	11.94	8.94	8.03	7.34	6.88	6.58	6.08	5.73	6.39 / 8.87		
GHLC-24	13.01	11.89	8.86	7.94	7.32	6.88	6.57	6.09	5.74	6.44 / 8.59		
GHLC-25	12.86	11.66	8.76	7.81	7.25	6.85	6.53	6.07	5.73	6.47 / 8.45		
GHLC-26	12.52	11.31	8.66	7.88	7.20	6.82	6.53	6.06	5.72	6.38 / 8.94		
GHLC-27	12.14	10.91	8.39	7.60	7.08	6.73	6.46	6.06	5.73	5.98 / 8.41		
GHLC-28	12.50	11.27	8.55	7.72	7.16	6.81	6.49	6.06	5.72	6.45 / 8.41		
GHLC-29	12.12	10.88	8.45	7.62	7.12	6.79	6.52	6.11	5.78	5.77 / 8.73		
GHLC-30	12.02	10.78	8.47	7.67	7.18	6.86	6.59	6.19	5.86	5.50 / 9.50		
GHLC-31	11.78	10.47	8.26	7.56	7.06	6.76	6.50	6.11	5.78	5.29 / 8.90		
GHLC-32	11.38	10.14	8.11	7.41	6.96	6.67	6.42	6.04	5.72	5.04 / 8.33		
GHLC-33	11.86	10.60	8.30	7.52	7.05	6.74	6.48	6.08	5.75	5.48 / 8.43		
GHLC-34	11.60	10.32	8.21	7.43	7.00	6.70	6.45	6.06	5.74	5.16 / 8.40		
GHLC-35	11.71	10.41	8.22	7.49	7.01	6.70	6.45	6.05	5.72	5.39 / 8.35		
GHLC-36	12.25	10.96	8.42	7.62	7.16	6.81	6.53	6.13	5.79	6.21 / 8.69		
GHLC-37	12.19	10.88	8.41	7.66	7.14	6.78	6.52	6.11	5.78	5.95 / 8.59		
GHLC-38	12.59	11.26	8.51	7.70	7.18	6.79	6.51	6.09	5.76	6.34 / 8.50		
GHLC-39	12.53	11.14	8.54	7.73	7.22	6.84	6.57	6.15	5.82	6.31 / 8.86		
GHLC-40	13.04	11.74	8.72	7.89	7.32	6.92	6.61	6.16	5.83	6.41 / 8.64		
GHLC-41	12.58	11.14	8.53	7.74	7.21	6.84	6.56	6.13	5.80	6.35 / 8.91		
GHLC-42	13.22	11.79	8.80	7.98	7.40	7.00	6.68	6.24	5.89	6.40 / 9.35		
GHLC-43	13.68	12.32	8.98	8.02	7.43	7.00	6.64	6.19	5.84	6.49 / 9.00		
GHLC-44	14.49	13.18	9.33	8.33	7.62	7.15	6.72	6.23	5.87	6.61 / 9.72		
GHLC-45	14.29	12.92	9.22	8.28	7.60	7.13	6.72	6.24	5.88	6.54 / 9.77		
GHLC-46	14.43	13.01	9.23	8.28	7.60	7.15	6.73	6.25	5.89	6.57 / 9.47		
GHLC-47	14.53	13.10	9.26	8.32	7.59	7.14	6.72	6.24	5.88	6.58 / 9.36		
GHLC-48	13.87	12.32	8.98	8.13	7.49	7.05	6.70	6.24	5.88	6.45 / 9.36		

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・ブローカーズ、BNPパリバ、JPモルガン、ヘアー・スターンズ、みずほ、UBS、メリル・ピッチ日本、大和SMBC、日興フィナンシャル

回号	Yield Curve Scenarios (%)									最低 / 最高 (%)	
	-300bp	-200bp	-100bp	-50bp	0bp	50bp	100bp	200bp	300bp		
GHLC-49	13.84	12.28	8.90	8.04	7.43	7.01	6.66	6.20	5.85	6.47	9.03
GHLC-50	14.70	13.16	9.32	8.37	7.66	7.22	6.81	6.32	5.94	6.58	9.26
GHLC-51	14.24	12.67	9.04	8.13	7.51	7.09	6.72	6.24	5.89	6.52	9.13
GHLC-52	13.97	12.29	8.97	8.04	7.48	7.07	6.72	6.27	5.91	6.53	9.00
GHLC-53	14.41	12.69	9.16	8.22	7.59	7.16	6.80	6.32	5.97	6.61	9.19
JHF-S1	13.05	12.18	9.11	8.07	7.38	6.90	6.56	6.02	5.66	5.76	9.74
JHF-S2	12.97	12.18	9.16	8.05	7.38	6.91	6.57	6.04	5.68	5.76	9.76
GHLC-S1	13.32	12.60	9.39	8.15	7.40	6.87	6.47	5.87	5.49	5.31	9.44
GHLC-S2	13.35	12.63	9.38	8.17	7.41	6.88	6.46	5.87	5.49	5.33	9.51
GHLC-S3	13.30	12.60	9.38	8.15	7.44	6.91	6.51	5.91	5.54	5.33	9.56
GHLC-S4	13.27	12.48	9.31	8.17	7.44	6.92	6.55	5.95	5.58	5.45	9.78
GHLC-S5	13.31	12.47	9.28	8.13	7.45	6.94	6.56	5.97	5.60	5.43	9.79
GHLC-S6	13.14	12.33	9.23	8.10	7.41	6.91	6.55	5.97	5.61	5.59	9.87
GHLC-S7	13.17	12.35	9.20	8.06	7.41	6.91	6.55	5.97	5.61	5.57	9.89
GHLC-S8	13.15	12.32	9.20	8.10	7.41	6.91	6.55	5.97	5.61	5.56	9.92
GHLC-S9	13.14	12.30	9.18	8.07	7.39	6.90	6.54	5.97	5.61	5.54	9.92
GHLC-S10	13.12	12.31	9.21	8.06	7.40	6.91	6.55	5.97	5.62	5.57	9.94

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 同じ。）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。