

P S J 予測統計値
(平均値)

2007年 7月 17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・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			
JHF-1	15.75	13.58	10.26	9.35	8.77	8.34	7.96	7.48	7.11	7.66 / 10.11		
JHF-2	15.81	13.58	10.33	9.40	8.79	8.31	7.94	7.46	7.08	7.67 / 10.11		
JHF-3	15.85	13.57	10.17	9.37	8.77	8.33	7.94	7.47	7.08	7.71 / 10.14		
GHLC-1	13.44	12.65	9.31	8.14	7.35	6.80	6.40	5.80	5.43	5.13 / 9.04		
GHLC-2	13.30	12.46	9.16	7.99	7.33	6.80	6.43	5.84	5.47	5.21 / 9.20		
GHLC-3	13.47	12.56	9.15	8.03	7.36	6.85	6.45	5.87	5.50	5.31 / 9.23		
GHLC-4	12.98	11.96	8.90	7.84	7.22	6.78	6.44	5.89	5.54	5.51 / 9.02		
GHLC-5	12.74	11.74	8.81	7.78	7.18	6.77	6.43	5.88	5.52	5.64 / 8.97		
GHLC-6	12.91	11.90	8.87	7.88	7.25	6.81	6.48	5.93	5.57	5.74 / 8.97		
GHLC-7	12.97	11.90	8.89	7.91	7.27	6.84	6.51	5.96	5.60	5.82 / 8.85		
GHLC-8	12.93	11.85	8.88	7.85	7.27	6.82	6.50	5.96	5.59	5.83 / 8.85		
GHLC-9	12.52	11.52	8.64	7.75	7.17	6.73	6.43	5.90	5.55	5.82 / 8.77		
GHLC-10	12.34	11.33	8.60	7.69	7.19	6.76	6.46	5.94	5.59	5.92 / 8.66		
GHLC-11	12.25	11.18	8.47	7.61	7.12	6.71	6.41	5.92	5.56	5.95 / 8.49		
GHLC-12	12.10	10.91	8.34	7.58	7.07	6.71	6.43	5.95	5.61	6.08 / 8.27		
GHLC-13	12.38	11.16	8.51	7.69	7.15	6.76	6.47	5.99	5.64	6.11 / 8.56		
GHLC-14	12.30	11.12	8.41	7.64	7.10	6.71	6.42	5.94	5.59	6.04 / 8.22		
GHLC-15	12.32	11.05	8.42	7.64	7.10	6.72	6.43	5.95	5.60	6.08 / 8.26		
GHLC-16	12.35	11.13	8.51	7.66	7.13	6.74	6.45	5.97	5.63	6.12 / 8.33		
GHLC-17	12.42	11.21	8.53	7.66	7.12	6.74	6.45	5.97	5.62	6.12 / 8.19		
GHLC-18	12.55	11.28	8.59	7.71	7.13	6.75	6.45	5.98	5.64	6.09 / 8.28		
GHLC-19	12.55	11.29	8.58	7.71	7.15	6.76	6.47	6.00	5.66	6.20 / 8.31		
GHLC-20	12.46	11.17	8.52	7.66	7.12	6.75	6.46	5.99	5.64	6.21 / 8.27		
GHLC-21	12.62	11.24	8.66	7.78	7.19	6.81	6.51	6.05	5.71	6.34 / 8.38		
GHLC-22	12.73	11.43	8.64	7.76	7.18	6.79	6.49	6.02	5.67	6.35 / 8.30		
GHLC-23	12.95	11.54	8.76	7.90	7.26	6.82	6.52	6.04	5.69	6.37 / 8.72		
GHLC-24	12.89	11.47	8.69	7.83	7.23	6.82	6.52	6.04	5.70	6.41 / 8.43		
GHLC-25	12.69	11.29	8.57	7.72	7.16	6.78	6.47	6.03	5.69	6.42 / 8.40		
GHLC-26	12.28	10.97	8.50	7.70	7.12	6.76	6.47	6.02	5.68	6.33 / 8.78		
GHLC-27	11.97	10.54	8.26	7.50	7.00	6.68	6.41	6.01	5.69	5.80 / 8.38		
GHLC-28	12.31	10.89	8.44	7.60	7.08	6.74	6.43	6.02	5.68	6.42 / 8.35		
GHLC-29	11.93	10.50	8.30	7.52	7.05	6.72	6.47	6.07	5.74	5.59 / 8.53		
GHLC-30	11.78	10.45	8.27	7.57	7.10	6.80	6.54	6.15	5.82	5.32 / 9.29		
GHLC-31	11.51	10.22	8.12	7.43	7.00	6.70	6.46	6.06	5.74	5.22 / 8.70		
GHLC-32	11.18	9.88	7.99	7.28	6.90	6.61	6.37	5.99	5.68	5.02 / 8.30		
GHLC-33	11.65	10.29	8.16	7.41	6.98	6.68	6.43	6.03	5.71	5.40 / 8.36		
GHLC-34	11.36	10.06	8.05	7.34	6.93	6.64	6.40	6.01	5.69	5.07 / 8.30		
GHLC-35	11.47	10.14	8.11	7.36	6.94	6.64	6.39	6.00	5.69	5.24 / 8.31		
GHLC-36	12.05	10.55	8.27	7.53	7.07	6.75	6.48	6.07	5.75	5.97 / 8.48		
GHLC-37	11.97	10.49	8.29	7.54	7.06	6.72	6.46	6.06	5.73	5.82 / 8.39		
GHLC-38	12.39	10.81	8.37	7.58	7.10	6.73	6.46	6.04	5.72	6.25 / 8.40		
GHLC-39	12.29	10.75	8.38	7.61	7.14	6.78	6.52	6.10	5.78	6.16 / 8.65		
GHLC-40	12.88	11.25	8.57	7.76	7.24	6.85	6.55	6.12	5.78	6.35 / 8.45		
GHLC-41	12.38	10.79	8.40	7.58	7.13	6.77	6.51	6.09	5.76	6.28 / 8.70		
GHLC-42	13.02	11.33	8.68	7.81	7.31	6.92	6.62	6.19	5.85	6.34 / 9.12		
GHLC-43	13.48	11.79	8.79	7.88	7.34	6.92	6.58	6.14	5.79	6.41 / 8.83		
GHLC-44	14.36	12.69	9.11	8.17	7.51	7.07	6.66	6.18	5.83	6.52 / 9.36		
GHLC-45	14.09	12.39	9.01	8.16	7.49	7.05	6.66	6.19	5.84	6.45 / 9.39		
GHLC-46	14.22	12.46	9.05	8.16	7.50	7.07	6.67	6.19	5.84	6.48 / 9.29		
GHLC-47	14.36	12.59	9.06	8.11	7.49	7.07	6.66	6.19	5.83	6.49 / 9.19		
GHLC-48	13.63	11.74	8.84	8.01	7.39	6.98	6.64	6.19	5.83	6.36 / 9.19		

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	13.62	11.72	8.72	7.88	7.33	6.94	6.60	6.15	5.80	6.39	8.86
GHLC-50	14.48	12.59	9.11	8.16	7.56	7.14	6.73	6.26	5.90	6.49	9.08
GHLC-51	14.03	12.11	8.88	7.98	7.42	7.01	6.65	6.19	5.84	6.43	8.95
GHLC-52	13.77	11.75	8.80	7.92	7.39	6.99	6.67	6.21	5.87	6.45	8.83
GHLC-53	14.13	12.10	8.95	8.10	7.49	7.08	6.73	6.27	5.91	6.51	9.02
JHF-S1	12.87	11.90	8.92	7.92	7.29	6.83	6.51	5.98	5.63	5.71	9.76
JHF-S2	12.92	11.86	9.10	8.09	7.36	6.86	6.52	5.99	5.63	5.71	9.78
GHLC-S1	13.43	12.39	9.19	8.06	7.37	6.86	6.49	5.91	5.53	5.25	9.45
GHLC-S2	13.22	12.32	9.11	7.97	7.30	6.79	6.41	5.84	5.47	5.27	9.52
GHLC-S3	13.19	12.29	9.14	8.01	7.34	6.83	6.45	5.88	5.50	5.29	9.58
GHLC-S4	13.12	12.16	9.11	7.97	7.35	6.84	6.49	5.91	5.54	5.40	9.80
GHLC-S5	13.17	12.18	9.10	7.93	7.37	6.87	6.51	5.93	5.57	5.38	9.80
GHLC-S6	13.02	12.02	8.98	7.97	7.31	6.84	6.50	5.93	5.58	5.54	9.90
GHLC-S7	12.99	11.99	9.01	7.96	7.31	6.84	6.49	5.93	5.58	5.52	9.91
GHLC-S8	12.99	12.00	9.01	7.97	7.31	6.84	6.50	5.94	5.58	5.51	9.94
GHLC-S9	13.00	11.98	8.96	7.94	7.30	6.83	6.49	5.93	5.58	5.49	9.95
GHLC-S10	12.99	12.00	8.95	7.93	7.30	6.84	6.50	5.94	5.59	5.51	9.96

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。