

P S J 予測統計値
(中央値)

2007年 9月 3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	13.97	13.21	10.31	9.45	9.00	8.24	7.93	7.47	7.28	7.90 / 10.24		
JHF-2	14.09	13.50	10.30	9.46	9.02	8.26	7.94	7.53	7.34	7.91 / 10.26		
JHF-3	13.93	13.46	10.36	9.54	9.07	8.24	7.94	7.55	7.37	7.92 / 10.27		
JHF-4	14.17	13.87	10.46	9.64	9.13	8.39	7.99	7.60	7.38	7.98 / 10.33		
JHF-5	14.65	14.21	10.60	9.70	9.16	8.43	7.98	7.52	7.36	7.82 / 10.34		
GHLC-1	13.35	12.65	10.30	9.10	7.93	7.15	6.62	5.96	5.38	5.54 / 9.18		
GHLC-2	13.16	12.74	10.22	9.00	7.95	7.19	6.61	5.97	5.41	5.61 / 9.23		
GHLC-3	13.26	12.88	10.41	8.98	8.00	7.21	6.63	5.99	5.43	5.68 / 9.20		
GHLC-4	13.01	12.36	9.52	8.70	7.65	7.05	6.53	5.91	5.48	5.83 / 9.02		
GHLC-5	13.20	12.64	9.34	8.51	7.61	7.01	6.54	5.86	5.52	5.95 / 8.96		
GHLC-6	13.05	12.30	9.42	8.65	7.69	7.07	6.55	5.93	5.58	6.08 / 8.94		
GHLC-7	12.98	12.40	9.60	8.47	7.62	7.03	6.60	5.88	5.56	6.13 / 8.91		
GHLC-8	13.07	12.32	9.49	8.65	7.69	7.07	6.60	5.92	5.58	6.17 / 8.89		
GHLC-9	12.84	12.24	9.25	8.31	7.54	6.97	6.51	5.91	5.63	6.12 / 8.84		
GHLC-10	12.72	12.29	9.44	8.53	7.59	6.98	6.52	5.86	5.63	6.21 / 8.78		
GHLC-11	12.48	11.98	9.21	8.34	7.54	6.91	6.48	5.90	5.66	6.22 / 8.66		
GHLC-12	11.97	11.84	9.23	8.22	7.44	6.94	6.39	5.90	5.67	6.33 / 8.48		
GHLC-13	12.36	12.12	9.38	8.28	7.60	6.88	6.42	5.90	5.69	6.37 / 8.72		
GHLC-14	12.26	12.18	9.39	8.29	7.51	6.88	6.47	5.92	5.69	6.30 / 8.42		
GHLC-15	12.24	12.11	9.32	8.18	7.50	6.86	6.42	5.92	5.68	6.35 / 8.45		
GHLC-16	12.24	12.08	9.39	8.19	7.46	6.94	6.41	5.91	5.68	6.38 / 8.48		
GHLC-17	12.21	12.05	9.18	8.18	7.46	6.92	6.41	5.93	5.70	6.38 / 8.38		
GHLC-18	12.08	11.79	9.08	8.24	7.46	6.91	6.42	5.93	5.70	6.32 / 8.42		
GHLC-19	12.06	11.76	9.08	8.12	7.47	6.91	6.42	5.94	5.74	6.44 / 8.44		
GHLC-20	12.17	11.77	9.20	8.27	7.41	6.92	6.43	5.96	5.77	6.44 / 8.66		
GHLC-21	12.47	11.93	9.30	8.25	7.51	6.92	6.46	5.99	5.86	6.60 / 8.60		
GHLC-22	12.53	12.02	9.32	8.28	7.42	6.88	6.51	5.99	5.85	6.60 / 8.47		
GHLC-23	12.64	12.06	9.33	8.27	7.41	6.90	6.52	6.02	5.88	6.61 / 8.58		
GHLC-24	12.53	11.86	9.20	8.22	7.37	6.89	6.54	6.05	5.92	6.66 / 8.95		
GHLC-25	12.24	11.57	9.07	8.09	7.28	6.84	6.54	6.07	5.95	6.67 / 9.09		
GHLC-26	11.91	11.48	8.89	7.94	7.28	6.81	6.43	5.98	5.85	6.57 / 8.57		
GHLC-27	11.37	10.76	8.74	7.82	7.23	6.75	6.43	6.12	6.00	6.67 / 9.05		
GHLC-28	11.97	11.58	8.94	7.84	7.19	6.77	6.45	6.05	5.93	6.65 / 9.16		
GHLC-29	11.54	10.85	8.65	7.89	7.31	6.77	6.43	6.14	6.01	6.63 / 8.73		
GHLC-30	11.22	10.35	8.54	7.82	7.28	6.78	6.48	6.20	6.06	6.62 / 9.36		
GHLC-31	11.24	10.41	8.45	7.77	7.18	6.71	6.39	6.15	6.02	6.51 / 8.81		
GHLC-32	10.71	10.25	8.32	7.54	7.01	6.69	6.35	6.14	6.02	6.45 / 8.87		
GHLC-33	11.41	10.84	8.49	7.64	7.15	6.82	6.41	6.17	6.04	6.54 / 9.02		
GHLC-34	10.73	10.34	8.24	7.47	7.00	6.76	6.36	6.15	6.02	6.41 / 8.71		
GHLC-35	10.79	10.45	8.18	7.40	7.03	6.71	6.38	6.16	6.03	6.44 / 8.61		
GHLC-36	11.90	10.77	8.62	7.72	7.20	6.84	6.47	6.21	6.08	6.56 / 8.61		
GHLC-37	11.43	10.88	8.44	7.58	7.10	6.84	6.45	6.21	6.07	6.53 / 8.56		
GHLC-38	11.85	11.17	8.63	7.66	7.14	6.84	6.50	6.22	6.08	6.58 / 8.62		
GHLC-39	11.85	11.09	8.59	7.70	7.20	6.92	6.50	6.24	6.11	6.53 / 8.80		
GHLC-40	12.39	11.37	8.96	7.88	7.25	6.91	6.55	6.22	6.08	6.66 / 8.62		
GHLC-41	11.31	10.87	8.59	7.64	7.14	6.82	6.46	6.24	6.11	6.56 / 8.85		
GHLC-42	12.18	11.53	8.94	7.93	7.31	6.98	6.61	6.30	6.15	6.64 / 9.26		
GHLC-43	12.52	12.04	8.98	8.00	7.29	7.01	6.61	6.28	6.14	6.75 / 9.24		
GHLC-44	13.05	12.74	9.45	8.36	7.44	7.07	6.65	6.33	6.18	6.91 / 9.31		
GHLC-45	12.71	12.33	9.30	8.24	7.41	7.04	6.66	6.34	6.19	6.80 / 9.16		
GHLC-46	12.83	12.40	9.31	8.26	7.43	7.02	6.72	6.33	6.18	6.81 / 9.23		

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、ヘアー・スターンズ、みずほ、UBS、メリル・ピッチ日本、大和SMB、日興シエラグループ

回号	Yield Curve Scenarios (%)									最低 / 最高 (%)	
	-300bp	-200bp	-100bp	-50bp	0bp	50bp	100bp	200bp	300bp		
GHLC-47	12.84	12.45	9.25	8.27	7.46	7.05	6.71	6.35	6.20	6.81 /	9.68
GHLC-48	12.36	11.96	8.88	8.02	7.32	6.99	6.67	6.33	6.19	6.63 /	9.56
GHLC-49	12.15	11.92	8.89	8.02	7.33	7.01	6.58	6.33	6.18	6.65 /	9.64
GHLC-50	12.86	12.44	9.40	8.25	7.48	7.07	6.78	6.40	6.24	6.81 /	9.73
GHLC-51	12.53	11.96	8.95	8.06	7.38	7.05	6.66	6.36	6.20	6.71 /	9.76
GHLC-52	12.32	11.99	8.81	7.94	7.29	6.99	6.66	6.36	6.20	6.71 /	9.44
GHLC-53	12.66	11.87	9.00	8.02	7.38	7.07	6.70	6.40	6.24	6.79 /	9.00
JHF-S1	12.73	11.98	9.78	8.78	7.63	6.88	6.54	5.91	5.69	5.99 /	9.76
JHF-S2	12.72	11.98	9.70	8.80	7.60	6.87	6.54	5.91	5.68	5.99 /	9.78
JHF-S3	12.71	12.00	9.81	8.86	7.65	6.89	6.53	5.92	5.71	5.99 /	9.80
GHLC-S1	12.88	12.35	10.08	8.96	7.79	7.05	6.56	5.98	5.45	5.60 /	9.15
GHLC-S2	12.76	12.16	10.30	8.96	7.85	7.08	6.56	5.99	5.47	5.66 /	9.22
GHLC-S3	12.81	12.19	10.28	9.02	7.89	7.09	6.58	6.01	5.49	5.66 /	9.25
GHLC-S4	12.74	12.18	10.09	9.01	7.97	7.10	6.57	5.98	5.54	5.73 /	9.57
GHLC-S5	12.87	12.52	10.20	8.89	7.97	7.04	6.70	5.97	5.55	5.71 /	9.58
GHLC-S6	12.76	12.08	9.92	8.84	7.90	6.97	6.53	5.94	5.64	5.86 /	9.79
GHLC-S7	12.73	12.07	9.95	8.98	7.86	6.94	6.53	5.93	5.62	5.84 /	9.80
GHLC-S8	12.72	12.03	9.95	8.96	7.82	6.91	6.52	5.93	5.62	5.85 /	9.84
GHLC-S9	12.68	12.03	9.96	8.62	7.78	6.90	6.51	5.93	5.62	5.82 /	9.85
GHLC-S10	12.67	12.02	9.95	8.72	7.74	6.90	6.51	5.93	5.62	5.83 /	9.87

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。