

P S J 予測統計値  
(中央値)

2007年 6月 1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	13.89	13.01	10.18	9.64	9.14	8.25	7.89	7.61	7.50	7.74 / 10.17	
JHF-2	13.76	12.86	10.46	9.66	9.17	8.24	7.92	7.63	7.49	7.62 / 10.14	
GHLC-1	13.01	12.30	10.03	8.76	7.78	7.13	6.58	5.98	5.41	5.36 / 9.08	
GHLC-2	13.14	12.37	9.89	8.76	7.81	7.16	6.58	6.05	5.42	5.44 / 9.13	
GHLC-3	13.40	12.74	10.06	8.70	7.75	7.17	6.60	6.06	5.43	5.50 / 9.11	
GHLC-4	12.81	11.71	9.35	8.43	7.58	7.03	6.53	5.89	5.50	5.69 / 8.98	
GHLC-5	12.88	11.68	9.14	8.44	7.53	6.98	6.50	5.81	5.57	5.81 / 8.98	
GHLC-6	12.92	11.89	9.24	8.44	7.60	7.03	6.57	5.84	5.59	5.95 / 8.95	
GHLC-7	12.85	11.95	9.23	8.43	7.53	6.99	6.61	5.80	5.58	5.99 / 8.87	
GHLC-8	12.77	11.79	9.22	8.41	7.58	7.02	6.62	5.84	5.62	6.01 / 8.86	
GHLC-9	12.49	11.72	9.03	8.21	7.44	6.90	6.50	5.84	5.61	5.99 / 8.81	
GHLC-10	12.52	11.71	9.10	8.18	7.47	6.83	6.52	5.83	5.65	6.08 / 8.70	
GHLC-11	12.12	11.42	9.00	7.93	7.39	6.81	6.51	5.86	5.66	6.09 / 8.58	
GHLC-12	11.88	11.31	8.84	7.93	7.20	6.96	6.44	5.87	5.70	6.21 / 8.48	
GHLC-13	12.03	11.54	8.96	8.10	7.39	6.83	6.48	5.86	5.70	6.30 / 8.67	
GHLC-14	12.12	11.74	8.94	8.05	7.35	6.84	6.51	5.88	5.70	6.18 / 8.34	
GHLC-15	11.93	11.58	8.89	8.01	7.29	6.87	6.48	5.88	5.69	6.23 / 8.38	
GHLC-16	12.15	11.58	8.94	7.97	7.26	6.91	6.47	5.88	5.71	6.27 / 8.53	
GHLC-17	12.14	11.39	9.02	8.12	7.28	6.88	6.48	5.90	5.72	6.26 / 8.33	
GHLC-18	12.15	11.20	9.06	8.07	7.31	6.91	6.47	5.89	5.71	6.23 / 8.48	
GHLC-19	12.17	11.47	9.05	8.03	7.28	6.90	6.47	5.90	5.72	6.34 / 8.40	
GHLC-20	11.89	11.19	8.93	7.97	7.22	6.92	6.46	5.92	5.74	6.35 / 8.39	
GHLC-21	12.20	11.39	9.01	7.97	7.31	6.97	6.45	5.96	5.83	6.48 / 8.56	
GHLC-22	12.20	11.31	9.01	7.99	7.36	6.92	6.50	5.95	5.83	6.49 / 8.54	
GHLC-23	12.19	11.25	9.06	7.96	7.37	6.93	6.51	5.98	5.85	6.51 / 8.52	
GHLC-24	12.27	11.30	8.95	7.91	7.38	6.88	6.50	6.02	5.89	6.55 / 9.44	
GHLC-25	12.13	10.83	8.86	7.80	7.36	6.88	6.48	6.02	5.90	6.54 / 8.60	
GHLC-26	11.60	10.68	8.59	7.64	7.16	6.93	6.37	5.95	5.83	6.48 / 9.29	
GHLC-27	11.05	10.45	8.51	7.61	7.15	6.77	6.37	6.08	5.95	6.30 / 8.49	
GHLC-28	11.88	10.92	8.70	7.63	7.14	6.85	6.41	6.02	5.90	6.49 / 8.54	
GHLC-29	10.84	10.36	8.47	7.66	7.25	6.78	6.36	6.10	5.98	6.11 / 8.69	
GHLC-30	10.77	10.18	8.41	7.66	7.23	6.70	6.37	6.16	6.03	5.87 / 9.47	
GHLC-31	10.99	10.08	8.30	7.54	7.14	6.73	6.30	6.09	5.97	5.40 / 8.77	
GHLC-32	10.67	9.97	8.01	7.37	7.04	6.68	6.29	6.09	5.97	5.18 / 8.39	
GHLC-33	11.02	10.20	8.20	7.57	7.07	6.79	6.32	6.12	5.99	5.77 / 8.46	
GHLC-34	10.60	10.03	8.04	7.35	7.02	6.75	6.29	6.10	5.98	5.40 / 8.38	
GHLC-35	10.59	10.09	8.10	7.45	6.97	6.69	6.30	6.12	6.00	5.60 / 8.54	
GHLC-36	11.25	10.37	8.36	7.60	7.12	6.83	6.37	6.16	6.03	6.41 / 8.64	
GHLC-37	11.03	10.29	8.30	7.58	7.03	6.79	6.35	6.15	6.02	6.16 / 8.46	
GHLC-38	11.31	10.57	8.50	7.64	7.09	6.76	6.39	6.15	6.03	6.43 / 8.51	
GHLC-39	11.39	10.42	8.40	7.61	7.11	6.84	6.39	6.20	6.06	6.55 / 8.81	
GHLC-40	11.92	10.94	8.68	7.71	7.34	6.92	6.47	6.19	6.05	6.48 / 8.58	
GHLC-41	11.07	10.49	8.44	7.62	7.09	6.73	6.41	6.20	6.07	6.51 / 8.87	
GHLC-42	11.79	10.86	8.67	7.72	7.30	6.91	6.52	6.26	6.12	6.63 / 9.30	
GHLC-43	12.33	11.29	8.82	7.86	7.38	6.90	6.53	6.23	6.10	6.74 / 8.65	
GHLC-44	13.03	12.26	9.18	8.21	7.54	7.00	6.57	6.27	6.14	6.69 / 8.89	
GHLC-45	12.77	12.05	9.01	8.10	7.47	7.03	6.60	6.28	6.14	6.74 / 9.00	
GHLC-46	12.84	12.15	9.06	8.14	7.53	7.06	6.61	6.29	6.14	6.75 / 9.59	
GHLC-47	12.78	11.98	9.07	8.14	7.57	7.09	6.59	6.31	6.16	6.60 / 9.58	
GHLC-48	12.27	11.28	8.70	7.88	7.40	6.93	6.58	6.29	6.14	6.60 / 8.99	
GHLC-49	12.20	11.29	8.70	7.89	7.41	6.93	6.54	6.27	6.13	6.67 / 8.98	

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・リンチ・ピエール・オレン、大和SMBC、日興シエクレール

回号	Yield Curve Scenarios ( % )									最低 / 最高 (%)	
	-300bp	-200bp	-100bp	-50bp	0bp	50bp	100bp	200bp	300bp		
GHLC-50	12.87	11.92	9.03	8.11	7.59	7.10	6.71	6.35	6.19	6.66 /	8.95
GHLC-51	12.62	11.63	8.78	7.95	7.49	7.03	6.58	6.31	6.16	6.69 /	9.14
GHLC-52	12.26	11.23	8.64	7.89	7.38	6.92	6.57	6.31	6.17	6.75 /	9.00
GHLC-53	12.83	11.55	9.00	8.11	7.55	6.98	6.65	6.37	6.20	6.78 /	9.08
JHF-S1	12.47	11.44	9.73	8.56	7.58	6.84	6.53	5.95	5.70	5.89 /	9.73
GHLC-S1	12.84	11.98	10.02	8.71	7.63	7.06	6.54	6.03	5.53	5.44 /	9.37
GHLC-S2	12.96	11.77	10.09	8.83	7.74	7.09	6.54	6.03	5.55	5.47 /	9.43
GHLC-S3	12.76	12.04	10.10	8.84	7.80	7.08	6.55	6.07	5.57	5.48 /	9.51
GHLC-S4	12.71	11.78	9.95	8.48	7.64	7.04	6.58	6.00	5.60	5.60 /	9.72
GHLC-S5	13.02	12.18	9.95	8.64	7.64	7.01	6.64	6.00	5.59	5.58 /	9.76
GHLC-S6	12.57	11.50	9.76	8.71	7.59	6.94	6.53	5.97	5.66	5.72 /	9.83
GHLC-S7	12.52	11.50	9.76	8.63	7.61	6.91	6.54	5.96	5.67	5.70 /	9.85
GHLC-S8	12.51	11.49	9.74	8.61	7.62	6.90	6.53	5.96	5.68	5.71 /	9.88
GHLC-S9	12.48	11.45	9.72	8.49	7.59	6.88	6.52	5.95	5.68	5.68 /	9.87
GHLC-S10	12.48	11.45	9.72	8.55	7.58	6.88	6.52	5.95	5.68	5.70 /	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。