

P S J 予測統計値
(中央値)

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・リンチ日本,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	13.79	12.33	9.84	9.21	8.80	8.10	7.80	7.57	7.49	7.66 / 10.11	
JHF-2	13.69	12.31	9.85	9.22	8.83	8.05	7.81	7.56	7.46	7.67 / 10.11	
JHF-3	13.98	12.54	9.90	9.28	8.96	8.03	7.70	7.46	7.32	7.71 / 10.14	
GHLC-1	12.86	11.90	9.65	8.28	7.40	6.94	6.39	5.74	5.36	5.13 / 9.04	
GHLC-2	12.97	11.90	9.54	8.16	7.44	6.92	6.42	5.78	5.40	5.21 / 9.20	
GHLC-3	13.28	12.23	9.48	8.24	7.45	6.92	6.48	5.84	5.43	5.31 / 9.23	
GHLC-4	12.94	11.31	9.07	7.97	7.31	6.86	6.45	5.76	5.49	5.51 / 9.02	
GHLC-5	12.61	11.20	8.85	7.90	7.27	6.78	6.44	5.72	5.53	5.64 / 8.97	
GHLC-6	12.52	11.15	8.92	7.98	7.34	6.84	6.42	5.77	5.58	5.74 / 8.97	
GHLC-7	12.87	11.70	8.88	7.90	7.28	6.89	6.38	5.73	5.56	5.82 / 8.85	
GHLC-8	12.75	11.28	8.92	7.97	7.32	6.84	6.38	5.78	5.59	5.83 / 8.85	
GHLC-9	12.46	11.40	8.79	7.85	7.21	6.69	6.35	5.80	5.62	5.82 / 8.77	
GHLC-10	12.52	11.31	8.83	7.74	7.24	6.74	6.36	5.80	5.61	5.92 / 8.66	
GHLC-11	12.07	11.26	8.67	7.62	7.14	6.65	6.34	5.83	5.65	5.95 / 8.49	
GHLC-12	11.80	11.01	8.46	7.54	7.01	6.58	6.33	5.82	5.66	6.08 / 8.27	
GHLC-13	12.47	10.63	8.76	7.87	7.15	6.52	6.36	5.83	5.66	6.11 / 8.56	
GHLC-14	11.95	11.12	8.65	7.62	7.11	6.59	6.38	5.85	5.67	6.04 / 8.22	
GHLC-15	11.89	10.73	8.62	7.58	7.06	6.59	6.38	5.83	5.67	6.08 / 8.26	
GHLC-16	12.20	10.76	8.65	7.73	7.06	6.57	6.35	5.84	5.67	6.12 / 8.33	
GHLC-17	12.11	10.88	8.65	7.73	7.05	6.56	6.37	5.85	5.69	6.12 / 8.19	
GHLC-18	12.14	10.50	8.63	7.73	7.10	6.54	6.37	5.85	5.69	6.09 / 8.28	
GHLC-19	12.16	10.76	8.67	7.72	7.09	6.57	6.35	5.87	5.70	6.20 / 8.31	
GHLC-20	11.86	10.80	8.61	7.57	6.99	6.66	6.35	5.87	5.71	6.21 / 8.27	
GHLC-21	12.14	10.52	8.54	7.67	7.07	6.69	6.34	5.91	5.78	6.34 / 8.38	
GHLC-22	12.12	10.94	8.62	7.59	7.14	6.74	6.38	5.90	5.78	6.35 / 8.30	
GHLC-23	12.17	10.77	8.62	7.61	7.13	6.76	6.40	5.92	5.80	6.37 / 8.72	
GHLC-24	12.10	10.86	8.56	7.58	7.11	6.77	6.38	5.96	5.84	6.41 / 8.43	
GHLC-25	11.90	10.94	8.46	7.49	6.96	6.79	6.36	5.98	5.87	6.42 / 8.40	
GHLC-26	11.34	10.61	8.19	7.42	6.90	6.72	6.25	5.90	5.78	6.33 / 8.78	
GHLC-27	11.15	10.17	8.04	7.30	6.96	6.63	6.26	6.02	5.91	5.80 / 8.38	
GHLC-28	11.50	10.60	8.26	7.38	6.84	6.79	6.29	5.96	5.84	6.42 / 8.35	
GHLC-29	11.08	10.11	8.10	7.31	7.01	6.59	6.25	6.04	5.92	5.59 / 8.53	
GHLC-30	10.81	9.95	8.07	7.23	7.03	6.57	6.27	6.10	5.97	5.32 / 9.29	
GHLC-31	10.63	9.86	7.97	7.19	6.97	6.55	6.22	6.05	5.92	5.22 / 8.70	
GHLC-32	10.66	9.74	7.65	7.08	6.95	6.51	6.21	6.03	5.92	5.02 / 8.30	
GHLC-33	10.95	9.95	7.83	7.10	6.98	6.61	6.25	6.05	5.93	5.40 / 8.36	
GHLC-34	10.60	9.79	7.65	7.06	6.94	6.53	6.21	6.04	5.92	5.07 / 8.30	
GHLC-35	10.57	9.83	7.72	7.04	6.84	6.58	6.22	6.06	5.94	5.24 / 8.31	
GHLC-36	11.15	10.10	7.95	7.32	7.03	6.68	6.28	6.10	5.98	5.97 / 8.48	
GHLC-37	11.02	10.02	7.89	7.18	6.95	6.64	6.27	6.10	5.97	5.82 / 8.39	
GHLC-38	11.31	10.25	8.07	7.33	6.95	6.68	6.28	6.09	5.96	6.25 / 8.40	
GHLC-39	11.39	10.12	7.98	7.31	7.04	6.71	6.30	6.12	5.99	6.16 / 8.65	
GHLC-40	11.83	10.58	8.27	7.44	7.05	6.80	6.34	6.12	5.99	6.35 / 8.45	
GHLC-41	11.06	10.10	8.05	7.32	6.95	6.60	6.31	6.13	6.00	6.28 / 8.70	
GHLC-42	11.87	10.53	8.25	7.45	7.09	6.79	6.38	6.19	6.05	6.34 / 9.12	
GHLC-43	11.90	10.88	8.42	7.51	7.11	6.77	6.40	6.17	6.04	6.41 / 8.83	
GHLC-44	12.97	11.72	8.70	7.80	7.18	6.94	6.50	6.20	6.07	6.52 / 9.36	
GHLC-45	12.53	11.29	8.55	7.72	7.15	6.83	6.47	6.21	6.07	6.45 / 9.39	
GHLC-46	12.68	11.38	8.59	7.77	7.18	6.91	6.49	6.22	6.07	6.48 / 9.29	
GHLC-47	12.73	11.42	8.60	7.81	7.23	6.93	6.51	6.24	6.09	6.49 / 9.19	
GHLC-48	12.21	10.79	8.31	7.53	7.15	6.78	6.43	6.21	6.07	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	12.19	10.79	8.30	7.55	7.17	6.76	6.41	6.20	6.07	6.39	8.86
GHLC-50	12.59	11.32	8.56	7.79	7.26	6.94	6.55	6.28	6.13	6.49	9.08
GHLC-51	12.42	11.00	8.36	7.65	7.22	6.84	6.46	6.23	6.09	6.43	8.95
GHLC-52	12.37	10.86	8.24	7.52	7.19	6.80	6.44	6.23	6.09	6.45	8.83
GHLC-53	12.34	11.10	8.32	7.60	7.23	6.85	6.50	6.28	6.13	6.51	9.02
JHF-S1	12.41	11.14	9.33	8.13	7.16	6.65	6.35	5.91	5.70	5.71	9.76
JHF-S2	12.40	11.14	9.44	8.11	7.16	6.63	6.35	5.92	5.71	5.71	9.78
GHLC-S1	12.79	11.69	9.52	8.36	7.40	6.87	6.38	5.77	5.50	5.25	9.45
GHLC-S2	12.70	11.74	9.45	8.11	7.29	6.89	6.41	5.80	5.51	5.27	9.52
GHLC-S3	12.68	11.64	9.60	8.28	7.37	6.88	6.45	5.82	5.55	5.29	9.58
GHLC-S4	12.57	11.51	9.50	8.29	7.39	6.87	6.46	5.83	5.58	5.40	9.80
GHLC-S5	12.92	11.78	9.47	8.11	7.40	6.96	6.49	5.81	5.58	5.38	9.80
GHLC-S6	12.43	11.23	9.41	8.33	7.31	6.73	6.41	5.87	5.66	5.54	9.90
GHLC-S7	12.40	11.24	9.40	8.28	7.30	6.73	6.40	5.87	5.68	5.52	9.91
GHLC-S8	12.40	11.24	9.38	8.34	7.34	6.70	6.38	5.87	5.67	5.51	9.94
GHLC-S9	12.32	11.22	9.37	8.28	7.33	6.71	6.39	5.88	5.68	5.49	9.95
GHLC-S10	12.34	11.22	9.29	8.20	7.29	6.71	6.39	5.88	5.69	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。