

P S J 予測統計値  
(平均値)

2007年 10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・ハート・スタンズ,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	15.94	14.67	10.82	9.66	8.91	8.47	8.08	7.55	7.23	7.77 / 10.19		
JHF-2	15.88	14.63	10.80	9.61	8.90	8.45	8.07	7.55	7.21	7.78 / 10.21		
JHF-3	16.09	14.82	10.89	9.67	8.91	8.48	8.10	7.57	7.24	7.83 / 10.23		
JHF-4	16.45	15.16	11.02	9.76	9.00	8.55	8.17	7.62	7.28	7.87 / 10.28		
JHF-5	16.96	15.64	11.12	9.79	9.01	8.53	8.14	7.58	7.24	7.79 / 10.35		
JHF-6	16.69	15.34	10.95	9.74	8.93	8.46	8.08	7.54	7.19	7.59 / 10.30		
GHLC-1	13.77	13.21	10.25	8.70	7.61	6.92	6.47	5.94	5.58	5.42 / 8.89		
GHLC-2	13.77	13.23	10.22	8.70	7.62	6.95	6.50	5.96	5.61	5.48 / 9.07		
GHLC-3	13.89	13.32	10.22	8.70	7.66	6.98	6.54	6.00	5.64	5.54 / 9.06		
GHLC-4	13.23	12.66	9.64	8.28	7.46	6.92	6.53	6.02	5.69	5.73 / 9.04		
GHLC-5	13.15	12.51	9.54	8.28	7.46	6.92	6.53	6.03	5.70	5.84 / 8.95		
GHLC-6	13.28	12.71	9.62	8.29	7.51	6.97	6.58	6.08	5.74	5.99 / 8.93		
GHLC-7	13.37	12.74	9.69	8.38	7.57	7.02	6.63	6.13	5.79	6.02 / 8.89		
GHLC-8	13.37	12.73	9.69	8.34	7.55	7.00	6.61	6.11	5.77	6.08 / 8.88		
GHLC-9	13.01	12.36	9.46	8.23	7.45	6.93	6.55	6.06	5.73	6.04 / 8.83		
GHLC-10	12.91	12.22	9.41	8.21	7.45	6.96	6.58	6.11	5.78	6.13 / 8.78		
GHLC-11	12.75	12.00	9.24	8.08	7.37	6.90	6.54	6.06	5.75	6.15 / 8.67		
GHLC-12	12.54	11.82	9.02	7.96	7.33	6.89	6.56	6.10	5.79	6.25 / 8.55		
GHLC-13	12.68	12.00	9.13	8.04	7.38	6.93	6.59	6.14	5.82	6.32 / 8.74		
GHLC-14	12.74	12.03	9.14	8.01	7.36	6.90	6.55	6.09	5.77	6.23 / 8.39		
GHLC-15	12.72	12.01	9.15	8.02	7.36	6.90	6.56	6.10	5.79	6.29 / 8.43		
GHLC-16	12.65	11.94	9.07	7.99	7.37	6.92	6.58	6.13	5.81	6.31 / 8.60		
GHLC-17	12.64	11.89	9.02	7.99	7.34	6.89	6.56	6.11	5.79	6.32 / 8.37		
GHLC-18	12.59	11.86	8.99	7.94	7.34	6.90	6.57	6.12	5.80	6.27 / 8.44		
GHLC-19	12.56	11.82	9.03	7.93	7.34	6.91	6.58	6.13	5.82	6.38 / 8.46		
GHLC-20	12.88	12.08	9.23	8.07	7.38	6.92	6.58	6.12	5.81	6.38 / 8.50		
GHLC-21	12.89	12.04	9.22	8.10	7.42	6.98	6.65	6.19	5.88	6.53 / 8.63		
GHLC-22	12.99	12.26	9.27	8.08	7.41	6.95	6.62	6.16	5.84	6.52 / 8.45		
GHLC-23	13.06	12.27	9.28	8.11	7.41	6.96	6.63	6.16	5.85	6.56 / 8.54		
GHLC-24	13.15	12.35	9.30	8.16	7.44	6.98	6.64	6.17	5.86	6.60 / 8.79		
GHLC-25	13.01	12.13	9.22	8.13	7.40	6.95	6.62	6.16	5.85	6.61 / 8.95		
GHLC-26	12.49	11.64	8.95	7.94	7.31	6.89	6.58	6.14	5.84	6.51 / 8.42		
GHLC-27	12.29	11.40	8.82	7.88	7.28	6.89	6.57	6.14	5.86	6.57 / 8.87		
GHLC-28	12.70	11.77	9.04	8.01	7.35	6.90	6.58	6.14	5.83	6.57 / 9.07		
GHLC-29	12.17	11.26	8.79	7.87	7.29	6.91	6.59	6.17	5.88	6.56 / 8.65		
GHLC-30	12.15	11.18	8.84	7.93	7.37	6.99	6.68	6.26	5.97	6.53 / 9.42		
GHLC-31	11.86	10.94	8.65	7.78	7.26	6.89	6.58	6.18	5.90	6.42 / 8.82		
GHLC-32	11.51	10.62	8.52	7.66	7.17	6.81	6.52	6.12	5.84	6.36 / 8.68		
GHLC-33	12.04	11.12	8.75	7.85	7.26	6.89	6.57	6.16	5.87	6.47 / 8.83		
GHLC-34	11.55	10.63	8.48	7.70	7.18	6.82	6.54	6.13	5.86	6.35 / 8.52		
GHLC-35	11.71	10.69	8.51	7.68	7.16	6.81	6.52	6.11	5.84	6.35 / 8.44		
GHLC-36	12.27	11.29	8.79	7.82	7.28	6.93	6.62	6.19	5.90	6.50 / 8.60		
GHLC-37	12.05	11.06	8.72	7.77	7.25	6.89	6.59	6.17	5.88	6.44 / 8.51		
GHLC-38	12.55	11.59	8.83	7.86	7.29	6.93	6.60	6.17	5.87	6.55 / 8.53		
GHLC-39	12.41	11.39	8.86	7.90	7.34	6.97	6.65	6.21	5.92	6.48 / 8.85		
GHLC-40	13.10	12.10	9.09	8.02	7.41	7.03	6.70	6.24	5.94	6.62 / 8.63		
GHLC-41	12.57	11.55	8.84	7.88	7.32	6.96	6.63	6.19	5.90	6.50 / 8.82		
GHLC-42	13.29	12.25	9.24	8.17	7.50	7.09	6.75	6.29	5.98	6.60 / 9.25		
GHLC-43	13.80	12.76	9.32	8.21	7.49	7.06	6.72	6.24	5.93	6.69 / 9.03		
GHLC-44	14.71	13.66	9.80	8.48	7.64	7.17	6.83	6.30	5.98	6.86 / 9.09		
GHLC-45	14.39	13.37	9.61	8.35	7.61	7.15	6.81	6.31	5.99	6.75 / 8.95		

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		
GHLC-46	14.56	13.49	9.70	8.43	7.64	7.17	6.83	6.32	5.99	6.75 /	9.02
GHLC-47	14.67	13.56	9.78	8.44	7.64	7.14	6.78	6.26	5.92	6.76 /	9.48
GHLC-48	13.77	12.62	9.43	8.21	7.54	7.09	6.72	6.24	5.92	6.58 /	9.46
GHLC-49	13.83	12.68	9.39	8.19	7.51	7.06	6.70	6.22	5.90	6.59 /	9.55
GHLC-50	14.80	13.69	9.90	8.52	7.72	7.21	6.86	6.33	6.00	6.75 /	9.62
GHLC-51	14.27	13.13	9.61	8.37	7.60	7.12	6.76	6.26	5.94	6.65 /	9.77
GHLC-52	13.94	12.71	9.39	8.29	7.58	7.11	6.76	6.28	5.97	6.64 /	9.64
GHLC-53	14.29	13.03	9.51	8.34	7.61	7.16	6.82	6.33	6.01	6.72 /	9.07
JHF-S1	13.26	12.59	9.70	8.41	7.54	7.01	6.61	6.13	5.79	5.90 /	9.71
JHF-S2	13.20	12.56	9.63	8.42	7.54	7.00	6.61	6.13	5.80	5.90 /	9.73
JHF-S3	13.28	12.60	9.66	8.43	7.56	7.02	6.62	6.14	5.81	5.91 /	9.80
GHLC-S1	13.46	12.84	9.96	8.57	7.56	6.89	6.46	5.93	5.57	5.49 /	9.03
GHLC-S2	13.48	12.88	10.00	8.56	7.57	6.89	6.45	5.92	5.56	5.54 /	9.09
GHLC-S3	13.52	12.93	10.04	8.56	7.57	6.91	6.48	5.95	5.59	5.56 /	9.16
GHLC-S4	13.45	12.82	9.92	8.47	7.58	7.01	6.60	6.07	5.73	5.62 /	9.54
GHLC-S5	13.48	12.82	9.89	8.48	7.59	7.01	6.61	6.08	5.74	5.59 /	9.55
GHLC-S6	13.34	12.73	9.79	8.41	7.56	7.00	6.61	6.09	5.76	5.73 /	9.77
GHLC-S7	13.31	12.69	9.76	8.40	7.57	7.01	6.61	6.10	5.76	5.73 /	9.80
GHLC-S8	13.26	12.67	9.74	8.43	7.55	6.99	6.59	6.09	5.75	5.73 /	9.82
GHLC-S9	13.25	12.69	9.76	8.36	7.54	6.99	6.59	6.08	5.75	5.71 /	9.83
GHLC-S10	13.26	12.65	9.74	8.41	7.54	6.99	6.59	6.08	5.75	5.71 /	9.85

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。