

P S J 予測統計値
(平均値)

2007年 6月 15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	15.97	13.95	10.36	9.40	8.84	8.44	8.09	7.67	7.35	7.72 / 10.13	
JHF-2	15.88	13.76	10.20	9.37	8.80	8.39	8.02	7.61	7.27	7.71 / 10.06	
GHLC-1	13.50	12.76	9.36	8.16	7.41	6.91	6.53	6.00	5.67	5.23 / 9.12	
GHLC-2	13.30	12.53	9.18	8.03	7.37	6.89	6.54	6.02	5.70	5.33 / 9.24	
GHLC-3	13.47	12.63	9.20	8.10	7.42	6.94	6.58	6.05	5.73	5.39 / 9.22	
GHLC-4	12.98	12.09	8.90	7.91	7.26	6.85	6.53	6.03	5.72	5.60 / 9.00	
GHLC-5	12.80	11.87	8.81	7.85	7.23	6.85	6.54	6.05	5.73	5.71 / 8.96	
GHLC-6	12.98	12.05	8.91	7.89	7.29	6.87	6.57	6.09	5.77	5.84 / 8.96	
GHLC-7	12.99	12.00	8.94	7.94	7.32	6.91	6.59	6.10	5.78	5.89 / 8.82	
GHLC-8	12.96	11.95	8.91	7.92	7.31	6.89	6.58	6.09	5.77	5.92 / 8.82	
GHLC-9	12.56	11.55	8.69	7.76	7.20	6.79	6.50	6.02	5.72	5.90 / 8.74	
GHLC-10	12.40	11.43	8.63	7.73	7.22	6.83	6.54	6.07	5.76	5.98 / 8.64	
GHLC-11	12.29	11.19	8.50	7.63	7.14	6.77	6.49	6.04	5.72	6.01 / 8.49	
GHLC-12	12.16	10.97	8.39	7.64	7.11	6.78	6.51	6.09	5.79	6.14 / 8.54	
GHLC-13	12.48	11.26	8.53	7.68	7.17	6.82	6.54	6.11	5.80	6.20 / 8.74	
GHLC-14	12.34	11.22	8.45	7.65	7.14	6.78	6.50	6.07	5.76	6.10 / 8.21	
GHLC-15	12.35	11.18	8.44	7.68	7.15	6.79	6.51	6.08	5.77	6.14 / 8.30	
GHLC-16	12.44	11.27	8.51	7.66	7.16	6.81	6.53	6.10	5.80	6.19 / 8.60	
GHLC-17	12.49	11.34	8.59	7.67	7.16	6.81	6.53	6.11	5.80	6.18 / 8.39	
GHLC-18	12.59	11.37	8.60	7.68	7.16	6.81	6.53	6.10	5.80	6.14 / 8.53	
GHLC-19	12.61	11.38	8.65	7.71	7.17	6.83	6.54	6.13	5.82	6.25 / 8.47	
GHLC-20	12.55	11.28	8.55	7.69	7.16	6.82	6.54	6.12	5.82	6.25 / 8.27	
GHLC-21	12.67	11.40	8.67	7.79	7.23	6.89	6.60	6.19	5.88	6.39 / 8.62	
GHLC-22	12.82	11.54	8.66	7.77	7.23	6.86	6.58	6.16	5.85	6.41 / 8.31	
GHLC-23	12.98	11.65	8.76	7.93	7.28	6.87	6.59	6.16	5.85	6.41 / 8.43	
GHLC-24	12.93	11.67	8.72	7.87	7.27	6.89	6.60	6.19	5.88	6.46 / 8.40	
GHLC-25	12.73	11.43	8.57	7.70	7.19	6.85	6.54	6.16	5.85	6.46 / 8.39	
GHLC-26	12.45	11.09	8.55	7.76	7.16	6.83	6.55	6.15	5.85	6.38 / 8.76	
GHLC-27	12.06	10.68	8.27	7.54	7.04	6.74	6.49	6.15	5.86	5.80 / 8.37	
GHLC-28	12.47	11.05	8.42	7.64	7.12	6.81	6.52	6.16	5.86	6.43 / 8.36	
GHLC-29	12.05	10.67	8.33	7.53	7.08	6.80	6.55	6.20	5.92	5.60 / 8.72	
GHLC-30	11.95	10.59	8.30	7.62	7.14	6.86	6.62	6.28	5.99	5.33 / 9.49	
GHLC-31	11.71	10.33	8.16	7.42	7.02	6.76	6.52	6.18	5.90	5.22 / 8.80	
GHLC-32	11.32	9.99	8.00	7.33	6.94	6.68	6.46	6.12	5.85	5.04 / 8.31	
GHLC-33	11.82	10.40	8.18	7.45	7.02	6.75	6.51	6.17	5.88	5.42 / 8.42	
GHLC-34	11.57	10.12	8.13	7.40	6.97	6.71	6.48	6.15	5.86	5.08 / 8.39	
GHLC-35	11.68	10.21	8.13	7.38	6.98	6.71	6.48	6.14	5.86	5.24 / 8.32	
GHLC-36	12.22	10.72	8.32	7.58	7.12	6.81	6.57	6.21	5.93	5.98 / 8.68	
GHLC-37	12.10	10.56	8.31	7.53	7.06	6.76	6.51	6.17	5.88	5.82 / 8.50	
GHLC-38	12.53	10.99	8.42	7.60	7.13	6.80	6.54	6.18	5.89	6.27 / 8.40	
GHLC-39	12.44	10.88	8.44	7.65	7.17	6.85	6.60	6.25	5.95	6.16 / 8.85	
GHLC-40	13.00	11.47	8.61	7.80	7.28	6.92	6.64	6.26	5.97	6.35 / 8.63	
GHLC-41	12.51	10.95	8.45	7.63	7.17	6.85	6.59	6.23	5.94	6.29 / 8.90	
GHLC-42	13.14	11.53	8.68	7.85	7.34	6.98	6.70	6.33	6.03	6.35 / 9.34	
GHLC-43	13.55	12.00	8.78	7.87	7.34	6.96	6.63	6.25	5.95	6.42 / 8.53	
GHLC-44	14.27	12.76	9.11	8.17	7.50	7.10	6.70	6.28	5.97	6.54 / 8.63	
GHLC-45	14.17	12.57	9.04	8.15	7.50	7.11	6.73	6.32	6.01	6.47 / 8.90	
GHLC-46	14.34	12.73	9.10	8.20	7.55	7.14	6.77	6.35	6.03	6.51 / 9.27	
GHLC-47	14.44	12.78	9.10	8.16	7.54	7.15	6.76	6.34	6.02	6.51 / 9.16	
GHLC-48	13.77	11.96	8.85	8.02	7.43	7.04	6.72	6.33	6.02	6.39 / 8.98	
GHLC-49	13.73	12.02	8.80	7.92	7.37	7.01	6.68	6.29	5.99	6.39 / 8.82	

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SMBC、日興フィナンシャルグループ

回号	Yield Curve Scenarios (%)									最低 / 最高 (%)	
	-300bp	-200bp	-100bp	-50bp	0bp	50bp	100bp	200bp	300bp		
GHLC-50	14.57	12.84	9.14	8.24	7.59	7.21	6.82	6.41	6.09	6.52 /	8.96
GHLC-51	14.20	12.34	8.95	8.00	7.46	7.08	6.74	6.33	6.03	6.46 /	8.92
GHLC-52	13.90	12.02	8.87	7.96	7.43	7.07	6.76	6.37	6.06	6.47 /	8.78
GHLC-53	14.27	12.35	9.01	8.11	7.52	7.15	6.81	6.41	6.10	6.54 /	9.12
JHF-S1	12.96	11.99	8.98	7.95	7.33	6.90	6.58	6.10	5.79	5.79 /	9.76
GHLC-S1	13.21	12.42	9.19	8.05	7.36	6.90	6.55	6.02	5.70	5.32 /	9.51
GHLC-S2	13.27	12.41	9.19	8.08	7.36	6.90	6.54	6.03	5.71	5.36 /	9.58
GHLC-S3	13.16	12.42	9.16	8.08	7.40	6.94	6.59	6.07	5.75	5.39 /	9.65
GHLC-S4	13.19	12.29	9.13	8.05	7.41	6.95	6.61	6.10	5.78	5.49 /	9.82
GHLC-S5	13.21	12.28	9.14	8.06	7.41	6.96	6.63	6.11	5.79	5.48 /	9.82
GHLC-S6	13.08	12.17	9.03	7.99	7.36	6.92	6.59	6.09	5.78	5.62 /	9.87
GHLC-S7	13.04	12.16	9.00	7.97	7.36	6.92	6.60	6.10	5.78	5.61 /	9.89
GHLC-S8	13.03	12.15	9.02	7.98	7.36	6.92	6.60	6.10	5.79	5.60 /	9.92
GHLC-S9	13.03	12.12	9.01	7.95	7.35	6.91	6.59	6.09	5.78	5.58 /	9.92
GHLC-S10	13.03	12.11	8.99	7.95	7.35	6.91	6.59	6.10	5.78	5.60 /	9.94

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。