

P S J 予測統計値
(中央値)

2007年 7月 2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,メルガン・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・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	13.85	12.63	10.01	9.38	8.96	8.14	7.82	7.59	7.52	7.72 / 10.15	
JHF-2	13.52	12.63	10.00	9.39	8.98	8.13	7.85	7.57	7.49	7.73 / 10.09	
JHF-3	13.82	12.84	10.07	9.46	9.07	8.19	7.78	7.51	7.44	7.64 / 10.15	
GHLC-1	12.95	12.24	9.76	8.43	7.54	7.00	6.42	5.81	5.36	5.19 / 9.02	
GHLC-2	13.03	12.01	9.68	8.28	7.51	6.97	6.42	5.87	5.40	5.29 / 9.15	
GHLC-3	13.32	12.39	9.61	8.34	7.54	6.97	6.48	5.94	5.40	5.37 / 9.21	
GHLC-4	12.96	11.35	9.12	8.11	7.37	6.87	6.46	5.79	5.48	5.57 / 9.00	
GHLC-5	12.83	11.58	8.93	8.04	7.34	6.82	6.43	5.74	5.53	5.69 / 8.98	
GHLC-6	12.57	11.36	8.99	8.11	7.40	6.88	6.48	5.77	5.57	5.80 / 8.96	
GHLC-7	12.86	11.86	8.93	8.05	7.36	6.93	6.43	5.73	5.54	5.88 / 8.86	
GHLC-8	12.86	11.48	8.98	8.12	7.39	6.87	6.43	5.77	5.58	5.91 / 8.86	
GHLC-9	12.60	11.33	8.95	8.07	7.36	6.77	6.46	5.80	5.61	5.86 / 8.78	
GHLC-10	12.55	11.37	8.90	7.92	7.31	6.75	6.43	5.80	5.62	5.97 / 8.69	
GHLC-11	12.09	11.44	8.77	7.78	7.24	6.65	6.43	5.82	5.65	5.98 / 8.54	
GHLC-12	11.86	10.90	8.56	7.57	7.05	6.72	6.35	5.83	5.66	6.12 / 8.56	
GHLC-13	12.48	10.99	8.87	7.93	7.26	6.70	6.38	5.83	5.68	6.16 / 8.85	
GHLC-14	11.97	11.04	8.72	7.77	7.16	6.67	6.42	5.84	5.67	6.07 / 8.27	
GHLC-15	11.91	11.29	8.72	7.72	7.12	6.72	6.41	5.84	5.67	6.12 / 8.32	
GHLC-16	12.21	11.06	8.74	7.88	7.13	6.70	6.38	5.84	5.67	6.17 / 8.62	
GHLC-17	12.13	11.02	8.75	7.88	7.12	6.70	6.40	5.86	5.70	6.17 / 8.41	
GHLC-18	12.14	11.10	8.71	7.78	7.17	6.70	6.39	5.86	5.70	6.12 / 8.55	
GHLC-19	12.15	10.81	8.74	7.79	7.15	6.73	6.38	5.87	5.71	6.23 / 8.58	
GHLC-20	12.03	10.67	8.74	7.72	7.05	6.86	6.37	5.89	5.73	6.24 / 8.31	
GHLC-21	12.08	10.67	8.70	7.74	7.19	6.85	6.37	5.91	5.80	6.39 / 8.64	
GHLC-22	12.11	10.85	8.78	7.71	7.17	6.81	6.41	5.92	5.80	6.39 / 8.35	
GHLC-23	12.15	10.83	8.77	7.70	7.15	6.85	6.42	5.94	5.82	6.39 / 8.87	
GHLC-24	12.02	10.87	8.71	7.68	7.18	6.84	6.42	5.98	5.85	6.44 / 8.59	
GHLC-25	12.05	10.61	8.60	7.58	7.14	6.82	6.39	6.00	5.88	6.47 / 8.45	
GHLC-26	11.70	10.71	8.39	7.48	7.01	6.78	6.29	5.92	5.79	6.38 / 8.94	
GHLC-27	11.13	10.28	8.15	7.40	7.07	6.69	6.29	6.04	5.92	5.98 / 8.41	
GHLC-28	11.60	10.71	8.41	7.45	6.97	6.80	6.32	5.98	5.86	6.45 / 8.41	
GHLC-29	10.95	10.20	8.23	7.46	7.13	6.66	6.28	6.06	5.94	5.77 / 8.73	
GHLC-30	10.92	10.05	8.19	7.39	7.12	6.63	6.30	6.12	5.99	5.50 / 9.50	
GHLC-31	10.91	9.93	8.06	7.34	7.04	6.60	6.24	6.07	5.94	5.29 / 8.90	
GHLC-32	10.52	9.84	7.75	7.20	6.96	6.58	6.24	6.05	5.93	5.04 / 8.33	
GHLC-33	10.81	10.04	7.96	7.24	7.01	6.67	6.28	6.08	5.96	5.48 / 8.43	
GHLC-34	10.59	9.87	7.77	7.18	6.95	6.59	6.24	6.06	5.95	5.16 / 8.40	
GHLC-35	10.58	9.92	7.84	7.19	6.88	6.63	6.26	6.08	5.96	5.39 / 8.35	
GHLC-36	10.92	10.20	8.08	7.38	7.06	6.75	6.29	6.12	5.99	6.21 / 8.69	
GHLC-37	10.97	10.11	8.02	7.37	6.96	6.72	6.30	6.12	5.99	5.95 / 8.59	
GHLC-38	11.29	10.37	8.20	7.41	7.00	6.70	6.32	6.11	5.99	6.34 / 8.50	
GHLC-39	11.38	10.22	8.11	7.38	7.05	6.76	6.33	6.14	6.01	6.31 / 8.86	
GHLC-40	11.60	10.71	8.40	7.52	7.16	6.85	6.38	6.13	6.00	6.41 / 8.64	
GHLC-41	11.06	10.24	8.19	7.40	7.00	6.64	6.34	6.15	6.01	6.35 / 8.91	
GHLC-42	11.72	10.65	8.37	7.50	7.20	6.82	6.42	6.21	6.07	6.40 / 9.35	
GHLC-43	12.20	11.14	8.53	7.62	7.25	6.82	6.43	6.20	6.06	6.49 / 9.00	
GHLC-44	12.89	12.01	8.84	7.93	7.32	6.99	6.53	6.23	6.09	6.61 / 9.72	
GHLC-45	12.65	11.56	8.69	7.84	7.30	6.93	6.52	6.24	6.09	6.54 / 9.77	
GHLC-46	12.81	11.67	8.73	7.89	7.33	6.96	6.53	6.25	6.10	6.57 / 9.47	
GHLC-47	12.83	11.70	8.74	7.92	7.39	6.99	6.53	6.26	6.11	6.58 / 9.36	
GHLC-48	12.29	11.03	8.42	7.64	7.27	6.85	6.46	6.24	6.10	6.45 / 9.36	

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・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-49	12.19	11.06	8.42	7.64	7.27	6.84	6.45	6.23	6.09	6.47	9.03
GHLC-50	12.84	11.57	8.70	7.90	7.42	6.99	6.59	6.30	6.15	6.58	9.26
GHLC-51	12.56	11.25	8.50	7.74	7.34	6.88	6.50	6.26	6.12	6.52	9.13
GHLC-52	12.34	11.04	8.36	7.61	7.25	6.84	6.48	6.26	6.12	6.53	9.00
GHLC-53	12.62	11.32	8.46	7.72	7.32	6.90	6.55	6.31	6.16	6.61	9.19
JHF-S1	12.46	11.19	9.40	8.30	7.25	6.69	6.42	5.91	5.69	5.76	9.74
JHF-S2	12.43	11.26	9.45	8.32	7.24	6.68	6.41	5.91	5.69	5.76	9.76
GHLC-S1	12.62	11.60	9.58	8.37	7.38	6.93	6.38	5.86	5.50	5.31	9.44
GHLC-S2	12.75	11.72	9.81	8.51	7.45	6.94	6.38	5.86	5.52	5.33	9.51
GHLC-S3	12.76	11.84	9.79	8.51	7.52	6.93	6.41	5.89	5.54	5.33	9.56
GHLC-S4	12.62	11.55	9.67	8.56	7.50	6.95	6.47	5.91	5.58	5.45	9.78
GHLC-S5	12.96	11.91	9.63	8.50	7.45	6.98	6.53	5.90	5.56	5.43	9.79
GHLC-S6	12.47	11.27	9.52	8.47	7.40	6.77	6.44	5.90	5.66	5.59	9.87
GHLC-S7	12.55	11.28	9.54	8.31	7.38	6.78	6.44	5.90	5.66	5.57	9.89
GHLC-S8	12.42	11.28	9.52	8.49	7.43	6.77	6.44	5.90	5.66	5.56	9.92
GHLC-S9	12.41	11.26	9.50	8.45	7.39	6.76	6.42	5.89	5.67	5.54	9.92
GHLC-S10	12.40	11.27	9.49	8.33	7.37	6.76	6.43	5.90	5.67	5.57	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。