

P S J 予測統計値
(平均値)

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・ハート・ストーンズ,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	16.01	14.58	10.69	9.72	8.99	8.53	8.11	7.60	7.22	7.74 / 10.17		
JHF-2	15.64	14.24	10.67	9.58	8.90	8.44	8.01	7.47	7.08	7.62 / 10.14		
GHLC-1	13.64	13.13	9.91	8.57	7.64	7.02	6.59	5.95	5.57	5.36 / 9.08		
GHLC-2	13.63	13.03	9.79	8.48	7.59	7.03	6.60	5.97	5.60	5.44 / 9.13		
GHLC-3	13.64	13.06	9.72	8.43	7.59	7.05	6.61	6.00	5.63	5.50 / 9.11		
GHLC-4	13.09	12.46	9.40	8.15	7.45	6.94	6.57	5.99	5.62	5.69 / 8.98		
GHLC-5	12.92	12.26	9.25	8.10	7.42	6.95	6.58	6.01	5.64	5.81 / 8.98		
GHLC-6	13.13	12.51	9.34	8.22	7.48	6.97	6.62	6.04	5.68	5.95 / 8.95		
GHLC-7	13.12	12.45	9.35	8.25	7.51	7.00	6.64	6.06	5.69	5.99 / 8.87		
GHLC-8	13.08	12.44	9.32	8.19	7.49	7.00	6.62	6.05	5.68	6.01 / 8.86		
GHLC-9	12.66	12.03	9.14	8.02	7.38	6.90	6.54	5.99	5.62	5.99 / 8.81		
GHLC-10	12.51	11.81	9.06	8.00	7.38	6.92	6.58	6.03	5.67	6.08 / 8.70		
GHLC-11	12.39	11.66	8.86	7.87	7.31	6.85	6.53	6.00	5.64	6.09 / 8.58		
GHLC-12	12.26	11.49	8.79	7.87	7.29	6.88	6.56	6.06	5.71	6.21 / 8.48		
GHLC-13	12.46	11.72	8.84	7.92	7.35	6.91	6.59	6.08	5.74	6.30 / 8.67		
GHLC-14	12.46	11.75	8.83	7.87	7.31	6.87	6.55	6.03	5.68	6.18 / 8.34		
GHLC-15	12.46	11.71	8.83	7.90	7.31	6.88	6.56	6.05	5.70	6.23 / 8.38		
GHLC-16	12.47	11.66	8.84	7.87	7.32	6.90	6.58	6.08	5.72	6.27 / 8.53		
GHLC-17	12.49	11.73	8.89	7.94	7.33	6.90	6.58	6.07	5.72	6.26 / 8.33		
GHLC-18	12.57	11.78	8.98	7.93	7.33	6.90	6.59	6.08	5.73	6.23 / 8.48		
GHLC-19	12.71	11.93	9.02	8.03	7.37	6.91	6.60	6.10	5.74	6.34 / 8.40		
GHLC-20	12.63	11.79	8.93	7.99	7.34	6.90	6.59	6.09	5.74	6.35 / 8.39		
GHLC-21	12.71	11.88	9.03	8.06	7.40	6.97	6.65	6.16	5.81	6.48 / 8.56		
GHLC-22	12.95	12.09	9.09	8.08	7.42	6.95	6.63	6.12	5.77	6.49 / 8.54		
GHLC-23	13.02	12.16	9.11	8.11	7.45	6.97	6.65	6.14	5.79	6.51 / 8.52		
GHLC-24	13.10	12.21	9.17	8.21	7.48	6.98	6.66	6.15	5.79	6.55 / 9.44		
GHLC-25	12.87	11.93	8.94	8.03	7.37	6.94	6.61	6.13	5.78	6.54 / 8.60		
GHLC-26	12.45	11.51	8.88	8.02	7.32	6.91	6.60	6.12	5.78	6.48 / 9.29		
GHLC-27	12.15	11.16	8.63	7.79	7.22	6.84	6.54	6.12	5.78	6.30 / 8.49		
GHLC-28	12.55	11.57	8.80	7.92	7.29	6.90	6.58	6.12	5.78	6.49 / 8.54		
GHLC-29	12.03	11.03	8.66	7.78	7.24	6.88	6.59	6.17	5.84	6.11 / 8.69		
GHLC-30	11.96	11.00	8.71	7.81	7.29	6.95	6.66	6.25	5.91	5.87 / 9.47		
GHLC-31	11.72	10.72	8.48	7.67	7.15	6.84	6.56	6.16	5.83	5.40 / 8.77		
GHLC-32	11.41	10.42	8.37	7.59	7.06	6.76	6.50	6.09	5.78	5.18 / 8.39		
GHLC-33	11.82	10.77	8.52	7.67	7.15	6.83	6.55	6.14	5.81	5.77 / 8.46		
GHLC-34	11.44	10.47	8.38	7.60	7.09	6.79	6.52	6.11	5.79	5.40 / 8.38		
GHLC-35	11.72	10.65	8.47	7.69	7.13	6.80	6.53	6.11	5.79	5.60 / 8.54		
GHLC-36	12.27	11.22	8.71	7.81	7.28	6.89	6.61	6.18	5.85	6.41 / 8.64		
GHLC-37	12.02	10.93	8.59	7.71	7.20	6.84	6.56	6.13	5.80	6.16 / 8.46		
GHLC-38	12.50	11.46	8.70	7.87	7.27	6.89	6.57	6.13	5.80	6.43 / 8.51		
GHLC-39	12.43	11.31	8.76	7.93	7.32	6.93	6.63	6.20	5.86	6.55 / 8.81		
GHLC-40	13.05	11.95	8.92	8.01	7.42	7.00	6.66	6.21	5.86	6.48 / 8.58		
GHLC-41	12.53	11.43	8.74	7.94	7.32	6.92	6.61	6.18	5.84	6.51 / 8.87		
GHLC-42	13.13	12.02	9.02	8.08	7.49	7.07	6.74	6.28	5.93	6.63 / 9.30		
GHLC-43	13.65	12.52	9.12	8.17	7.51	7.07	6.69	6.22	5.87	6.74 / 8.65		
GHLC-44	14.34	13.23	9.39	8.37	7.63	7.17	6.74	6.22	5.86	6.69 / 8.89		
GHLC-45	14.16	13.06	9.39	8.35	7.67	7.18	6.74	6.24	5.87	6.74 / 9.00		
GHLC-46	14.42	13.26	9.51	8.43	7.73	7.23	6.79	6.27	5.90	6.75 / 9.59		
GHLC-47	14.51	13.31	9.48	8.44	7.72	7.22	6.78	6.27	5.90	6.60 / 9.58		
GHLC-48	13.67	12.46	9.19	8.21	7.58	7.10	6.71	6.24	5.88	6.60 / 8.99		
GHLC-49	13.82	12.59	9.14	8.21	7.54	7.08	6.70	6.22	5.86	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

回号	Yield Curve Scenarios (%)									最低 / 最高(%)
	-300bp	-200bp	-100bp	-50bp	0bp	50bp	100bp	200bp	300bp	
GHLC-50	14.71	13.48	9.52	8.48	7.75	7.31	6.88	6.36	5.99	6.66 / 8.95
GHLC-51	14.29	12.98	9.31	8.35	7.62	7.18	6.77	6.29	5.92	6.69 / 9.14
GHLC-52	13.94	12.62	9.24	8.26	7.60	7.15	6.79	6.32	5.96	6.75 / 9.00
GHLC-53	14.41	13.12	9.45	8.46	7.74	7.27	6.86	6.37	6.00	6.78 / 9.08
JHF-S1	13.07	12.39	9.43	8.28	7.52	7.00	6.62	6.05	5.69	5.89 / 9.73
GHLC-S1	13.44	12.85	9.67	8.47	7.57	7.01	6.59	5.98	5.60	5.44 / 9.37
GHLC-S2	13.47	12.86	9.72	8.46	7.57	7.02	6.60	5.98	5.61	5.47 / 9.43
GHLC-S3	13.48	12.94	9.75	8.50	7.62	7.07	6.65	6.03	5.66	5.48 / 9.51
GHLC-S4	13.29	12.63	9.59	8.32	7.58	7.05	6.65	6.06	5.68	5.60 / 9.72
GHLC-S5	13.32	12.68	9.59	8.36	7.59	7.07	6.67	6.07	5.71	5.58 / 9.76
GHLC-S6	13.18	12.55	9.48	8.30	7.53	7.01	6.62	6.04	5.67	5.72 / 9.83
GHLC-S7	13.17	12.53	9.48	8.30	7.54	7.01	6.63	6.05	5.68	5.70 / 9.85
GHLC-S8	13.17	12.55	9.49	8.30	7.54	7.01	6.63	6.05	5.69	5.71 / 9.88
GHLC-S9	13.17	12.50	9.48	8.28	7.53	6.99	6.62	6.04	5.68	5.68 / 9.87
GHLC-S10	13.18	12.56	9.49	8.31	7.54	7.01	6.64	6.06	5.70	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。