

PSJ 予測統計値
(平均値)

2007年 8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	15.81	14.38	10.57	9.63	8.91	8.46	8.04	7.53	7.15	7.76 / 10.18	
JHF-2	15.83	14.35	10.63	9.59	8.91	8.47	8.02	7.51	7.12	7.77 / 10.19	
JHF-3	15.93	14.45	10.64	9.63	8.94	8.50	8.04	7.52	7.13	7.82 / 10.20	
JHF-4	16.28	14.77	10.75	9.75	9.01	8.57	8.11	7.58	7.19	7.84 / 10.27	
GHLC-1	13.54	13.02	9.91	8.56	7.60	6.96	6.51	5.85	5.46	5.40 / 9.11	
GHLC-2	13.43	12.82	9.74	8.43	7.55	6.96	6.53	5.88	5.50	5.47 / 9.10	
GHLC-3	13.58	12.95	9.79	8.47	7.57	7.00	6.55	5.92	5.53	5.54 / 9.09	
GHLC-4	13.10	12.43	9.44	8.21	7.43	6.90	6.54	5.94	5.56	5.73 / 9.01	
GHLC-5	12.85	12.22	9.30	8.11	7.39	6.90	6.53	5.93	5.56	5.84 / 8.96	
GHLC-6	13.06	12.36	9.41	8.19	7.46	6.94	6.57	5.98	5.61	5.97 / 8.96	
GHLC-7	13.06	12.36	9.37	8.24	7.48	6.98	6.60	6.02	5.64	6.04 / 8.90	
GHLC-8	13.07	12.33	9.34	8.17	7.46	6.96	6.59	6.01	5.64	6.07 / 8.88	
GHLC-9	12.67	11.93	9.11	8.02	7.36	6.87	6.51	5.96	5.59	6.03 / 8.82	
GHLC-10	12.47	11.79	9.07	8.02	7.36	6.89	6.54	6.00	5.63	6.13 / 8.74	
GHLC-11	12.42	11.64	8.89	7.90	7.29	6.84	6.50	5.97	5.60	6.14 / 8.63	
GHLC-12	12.18	11.37	8.72	7.82	7.24	6.82	6.51	6.01	5.65	6.27 / 8.40	
GHLC-13	12.55	11.68	8.94	7.94	7.32	6.88	6.56	6.04	5.68	6.31 / 8.63	
GHLC-14	12.41	11.61	8.84	7.88	7.28	6.83	6.50	5.99	5.64	6.23 / 8.36	
GHLC-15	12.43	11.58	8.82	7.85	7.28	6.83	6.51	5.99	5.64	6.27 / 8.39	
GHLC-16	12.46	11.65	8.96	7.94	7.30	6.86	6.53	6.02	5.66	6.32 / 8.39	
GHLC-17	12.55	11.74	8.94	7.95	7.29	6.85	6.53	6.02	5.66	6.32 / 8.31	
GHLC-18	12.68	11.81	9.03	8.01	7.32	6.86	6.54	6.02	5.68	6.28 / 8.34	
GHLC-19	12.67	11.78	8.99	8.02	7.33	6.88	6.56	6.05	5.70	6.39 / 8.37	
GHLC-20	12.56	11.73	8.98	7.93	7.30	6.86	6.54	6.04	5.69	6.39 / 8.38	
GHLC-21	12.73	11.78	9.01	8.07	7.37	6.91	6.60	6.10	5.74	6.54 / 8.57	
GHLC-22	12.86	11.95	9.07	8.05	7.37	6.89	6.58	6.07	5.71	6.55 / 8.55	
GHLC-23	13.03	12.10	9.18	8.17	7.46	6.93	6.60	6.09	5.73	6.56 / 9.47	
GHLC-24	12.98	12.07	9.12	8.16	7.42	6.92	6.60	6.09	5.74	6.61 / 9.09	
GHLC-25	12.78	11.80	8.96	8.00	7.34	6.89	6.56	6.08	5.73	6.62 / 8.64	
GHLC-26	12.40	11.47	8.89	8.01	7.31	6.87	6.55	6.07	5.72	6.53 / 9.62	
GHLC-27	12.06	11.00	8.63	7.77	7.16	6.78	6.48	6.06	5.73	6.29 / 8.48	
GHLC-28	12.46	11.45	8.78	7.89	7.25	6.85	6.53	6.07	5.72	6.58 / 8.47	
GHLC-29	12.01	10.99	8.67	7.83	7.20	6.82	6.53	6.11	5.77	6.07 / 8.60	
GHLC-30	11.85	10.88	8.62	7.77	7.25	6.89	6.61	6.18	5.85	5.86 / 9.33	
GHLC-31	11.64	10.62	8.50	7.67	7.11	6.79	6.51	6.11	5.78	5.40 / 8.73	
GHLC-32	11.31	10.30	8.32	7.55	7.01	6.71	6.44	6.05	5.73	5.15 / 8.38	
GHLC-33	11.75	10.66	8.50	7.65	7.11	6.77	6.48	6.07	5.74	5.75 / 8.44	
GHLC-34	11.47	10.46	8.41	7.63	7.06	6.72	6.46	6.05	5.73	5.36 / 8.60	
GHLC-35	11.60	10.48	8.37	7.60	7.06	6.73	6.45	6.04	5.72	5.54 / 8.51	
GHLC-36	12.12	11.02	8.62	7.81	7.22	6.83	6.55	6.12	5.78	6.43 / 8.51	
GHLC-37	12.04	10.94	8.63	7.82	7.20	6.81	6.53	6.10	5.77	6.15 / 8.90	
GHLC-38	12.46	11.39	8.73	7.88	7.26	6.86	6.54	6.10	5.76	6.45 / 8.88	
GHLC-39	12.37	11.19	8.75	7.90	7.29	6.88	6.59	6.15	5.81	6.41 / 8.93	
GHLC-40	12.98	11.85	8.95	8.06	7.40	6.96	6.62	6.16	5.82	6.53 / 8.87	
GHLC-41	12.47	11.28	8.74	7.87	7.28	6.88	6.57	6.13	5.79	6.44 / 8.80	
GHLC-42	13.08	11.94	9.06	8.10	7.47	7.03	6.69	6.24	5.88	6.51 / 9.15	
GHLC-43	13.59	12.42	9.17	8.24	7.50	7.05	6.66	6.19	5.83	6.60 / 9.37	
GHLC-44	14.47	13.35	9.65	8.52	7.76	7.23	6.77	6.25	5.87	6.75 / 10.80	
GHLC-45	14.22	13.03	9.54	8.46	7.72	7.19	6.75	6.25	5.88	6.64 / 10.86	
GHLC-46	14.35	13.13	9.54	8.48	7.72	7.20	6.76	6.25	5.87	6.66 / 10.56	
GHLC-47	14.43	13.22	9.49	8.48	7.70	7.20	6.76	6.24	5.86	6.67 / 10.23	

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・ブライザー、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-48	13.73	12.41	9.21	8.30	7.58	7.10	6.71	6.23	5.87	6.50 / 10.23
GHLC-49	13.69	12.40	9.13	8.17	7.49	7.04	6.67	6.20	5.84	6.52 / 9.41
GHLC-50	14.64	13.35	9.56	8.53	7.75	7.26	6.84	6.32	5.95	6.68 / 9.88
GHLC-51	14.15	12.77	9.25	8.28	7.58	7.13	6.73	6.24	5.88	6.58 / 9.50
GHLC-52	13.82	12.46	9.17	8.23	7.54	7.10	6.73	6.26	5.90	6.59 / 9.38
GHLC-53	14.23	12.81	9.31	8.38	7.65	7.19	6.81	6.32	5.96	6.66 / 9.57
JHF-S1	13.02	12.33	9.39	8.26	7.49	6.97	6.60	6.03	5.67	5.94 / 9.73
JHF-S2	12.98	12.31	9.41	8.27	7.49	6.97	6.60	6.04	5.68	5.94 / 9.75
GHLC-S1	13.32	12.71	9.73	8.45	7.52	6.95	6.52	5.88	5.49	5.48 / 9.16
GHLC-S2	13.36	12.74	9.68	8.43	7.52	6.95	6.52	5.87	5.50	5.52 / 9.23
GHLC-S3	13.29	12.70	9.71	8.42	7.54	6.98	6.55	5.92	5.54	5.53 / 9.33
GHLC-S4	13.27	12.64	9.62	8.38	7.56	7.01	6.59	5.97	5.59	5.60 / 9.64
GHLC-S5	13.31	12.62	9.68	8.37	7.57	7.01	6.60	5.98	5.60	5.59 / 9.65
GHLC-S6	13.15	12.48	9.56	8.33	7.53	6.98	6.59	5.99	5.62	5.73 / 9.82
GHLC-S7	13.15	12.47	9.55	8.28	7.52	6.97	6.58	5.99	5.62	5.74 / 9.84
GHLC-S8	13.14	12.45	9.53	8.31	7.52	6.97	6.58	5.99	5.61	5.73 / 9.86
GHLC-S9	13.08	12.44	9.47	8.28	7.51	6.96	6.58	5.98	5.61	5.71 / 9.89
GHLC-S10	13.11	12.43	9.51	8.30	7.51	6.97	6.58	5.99	5.62	5.72 / 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。