

P S J 予測統計値  
(平均値)

2007年 8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,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・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	15.77	14.14	10.45	9.49	8.86	8.42	8.01	7.52	7.13	7.77 / 10.16		
JHF-2	15.78	14.04	10.43	9.48	8.86	8.42	7.99	7.49	7.11	7.79 / 10.18		
JHF-3	15.89	14.19	10.43	9.50	8.90	8.46	8.01	7.50	7.12	7.83 / 10.21		
JHF-4	16.33	14.51	10.57	9.61	8.96	8.53	8.08	7.56	7.17	7.72 / 10.18		
GHLC-1	13.58	12.96	9.66	8.43	7.50	6.89	6.46	5.83	5.45	5.28 / 8.95		
GHLC-2	13.51	12.86	9.55	8.28	7.46	6.91	6.49	5.86	5.49	5.36 / 9.09		
GHLC-3	13.57	12.89	9.54	8.31	7.48	6.94	6.50	5.90	5.51	5.42 / 9.14		
GHLC-4	13.05	12.27	9.19	8.05	7.34	6.85	6.49	5.91	5.55	5.64 / 9.02		
GHLC-5	12.85	12.08	9.06	7.97	7.30	6.84	6.48	5.90	5.54	5.76 / 8.94		
GHLC-6	13.08	12.28	9.16	8.10	7.38	6.90	6.54	5.96	5.59	5.88 / 8.95		
GHLC-7	13.04	12.24	9.18	8.08	7.40	6.92	6.57	5.99	5.62	5.96 / 8.89		
GHLC-8	13.04	12.24	9.14	8.07	7.39	6.91	6.55	5.98	5.61	5.99 / 8.87		
GHLC-9	12.66	11.82	8.97	7.91	7.29	6.82	6.48	5.93	5.57	5.97 / 8.81		
GHLC-10	12.47	11.64	8.84	7.89	7.29	6.83	6.51	5.97	5.61	6.06 / 8.73		
GHLC-11	12.37	11.50	8.71	7.78	7.22	6.78	6.47	5.94	5.58	6.09 / 8.57		
GHLC-12	12.19	11.21	8.58	7.72	7.16	6.77	6.48	5.98	5.63	6.21 / 8.35		
GHLC-13	12.36	11.45	8.68	7.81	7.25	6.82	6.51	6.01	5.66	6.26 / 8.61		
GHLC-14	12.40	11.47	8.67	7.79	7.21	6.78	6.47	5.97	5.62	6.17 / 8.31		
GHLC-15	12.37	11.41	8.67	7.75	7.21	6.78	6.47	5.97	5.62	6.22 / 8.35		
GHLC-16	12.33	11.34	8.62	7.75	7.22	6.79	6.49	5.99	5.64	6.26 / 8.38		
GHLC-17	12.44	11.43	8.75	7.77	7.22	6.79	6.49	5.99	5.64	6.26 / 8.28		
GHLC-18	12.47	11.51	8.75	7.83	7.23	6.80	6.49	6.00	5.65	6.23 / 8.32		
GHLC-19	12.64	11.65	8.82	7.91	7.26	6.82	6.51	6.03	5.67	6.33 / 8.35		
GHLC-20	12.57	11.52	8.80	7.84	7.22	6.81	6.50	6.02	5.67	6.34 / 8.34		
GHLC-21	12.58	11.52	8.84	7.89	7.28	6.87	6.56	6.07	5.72	6.49 / 8.42		
GHLC-22	12.81	11.79	8.90	7.96	7.29	6.85	6.53	6.04	5.69	6.49 / 8.38		
GHLC-23	12.91	11.85	8.91	7.93	7.34	6.86	6.56	6.06	5.71	6.51 / 8.56		
GHLC-24	12.95	11.90	8.96	8.08	7.36	6.88	6.57	6.08	5.72	6.56 / 9.08		
GHLC-25	12.73	11.63	8.80	7.91	7.27	6.84	6.53	6.06	5.71	6.57 / 8.48		
GHLC-26	12.38	11.27	8.74	7.89	7.21	6.82	6.52	6.05	5.70	6.46 / 9.01		
GHLC-27	12.03	10.88	8.45	7.63	7.10	6.73	6.45	6.04	5.71	6.13 / 8.45		
GHLC-28	12.41	11.28	8.63	7.78	7.19	6.81	6.49	6.05	5.70	6.55 / 8.42		
GHLC-29	11.95	10.78	8.47	7.67	7.13	6.77	6.50	6.09	5.76	5.93 / 8.54		
GHLC-30	11.83	10.73	8.50	7.71	7.19	6.85	6.58	6.17	5.84	5.69 / 9.30		
GHLC-31	11.65	10.47	8.39	7.57	7.07	6.76	6.49	6.09	5.76	5.35 / 8.71		
GHLC-32	11.25	10.16	8.20	7.45	6.97	6.67	6.42	6.03	5.71	5.09 / 8.35		
GHLC-33	11.70	10.51	8.33	7.57	7.05	6.73	6.46	6.06	5.73	5.56 / 8.42		
GHLC-34	11.32	10.20	8.21	7.45	6.99	6.69	6.43	6.03	5.71	5.27 / 8.34		
GHLC-35	11.57	10.40	8.26	7.54	7.02	6.69	6.43	6.03	5.71	5.49 / 8.38		
GHLC-36	12.12	10.87	8.50	7.68	7.17	6.80	6.52	6.10	5.77	6.35 / 8.49		
GHLC-37	11.95	10.71	8.45	7.68	7.13	6.77	6.50	6.09	5.75	6.02 / 8.41		
GHLC-38	12.44	11.22	8.57	7.78	7.21	6.81	6.52	6.09	5.75	6.38 / 8.68		
GHLC-39	12.32	11.03	8.59	7.77	7.23	6.84	6.56	6.13	5.79	6.33 / 8.66		
GHLC-40	12.93	11.62	8.76	7.92	7.33	6.92	6.59	6.15	5.80	6.44 / 8.67		
GHLC-41	12.45	11.13	8.58	7.80	7.23	6.83	6.55	6.12	5.77	6.38 / 8.71		
GHLC-42	13.04	11.65	8.85	7.94	7.40	6.99	6.66	6.22	5.87	6.43 / 9.13		
GHLC-43	13.54	12.19	8.94	8.04	7.42	7.00	6.62	6.16	5.82	6.52 / 8.85		
GHLC-44	14.32	13.05	9.29	8.33	7.62	7.16	6.72	6.23	5.86	6.66 / 9.45		
GHLC-45	14.15	12.78	9.27	8.36	7.62	7.14	6.72	6.23	5.86	6.56 / 10.12		
GHLC-46	14.33	12.96	9.34	8.34	7.64	7.16	6.72	6.23	5.86	6.59 / 10.19		
GHLC-47	14.46	13.03	9.40	8.36	7.64	7.16	6.72	6.23	5.86	6.60 / 10.16		

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-48	13.70	12.20	9.08	8.20	7.54	7.06	6.69	6.22	5.87	6.46 / 10.16
GHLC-49	13.69	12.26	9.02	8.15	7.46	7.01	6.65	6.19	5.83	6.48 / 9.53
GHLC-50	14.54	13.06	9.36	8.38	7.66	7.22	6.80	6.30	5.93	6.62 / 9.18
GHLC-51	14.09	12.57	9.12	8.20	7.53	7.09	6.70	6.22	5.87	6.52 / 9.41
GHLC-52	13.82	12.23	9.04	8.12	7.49	7.06	6.71	6.25	5.89	6.53 / 9.28
GHLC-53	14.19	12.57	9.17	8.22	7.58	7.16	6.77	6.31	5.94	6.61 / 9.15
JHF-S1	12.98	12.21	9.23	8.11	7.41	6.92	6.56	6.01	5.65	5.85 / 9.73
JHF-S2	13.03	12.22	9.20	8.17	7.42	6.92	6.56	6.02	5.65	5.85 / 9.75
GHLC-S1	13.33	12.65	9.49	8.27	7.44	6.89	6.48	5.86	5.48	5.38 / 9.31
GHLC-S2	13.35	12.66	9.52	8.27	7.44	6.89	6.48	5.85	5.48	5.41 / 9.38
GHLC-S3	13.39	12.71	9.51	8.26	7.48	6.93	6.52	5.90	5.52	5.43 / 9.47
GHLC-S4	13.18	12.46	9.39	8.18	7.46	6.94	6.55	5.95	5.58	5.51 / 9.74
GHLC-S5	13.17	12.45	9.35	8.17	7.47	6.94	6.55	5.97	5.58	5.51 / 9.74
GHLC-S6	13.16	12.39	9.30	8.18	7.45	6.93	6.56	5.97	5.60	5.66 / 9.87
GHLC-S7	13.14	12.38	9.31	8.15	7.43	6.91	6.55	5.96	5.59	5.65 / 9.88
GHLC-S8	13.15	12.38	9.30	8.16	7.44	6.92	6.55	5.96	5.60	5.65 / 9.92
GHLC-S9	13.13	12.31	9.25	8.13	7.42	6.91	6.54	5.96	5.60	5.62 / 9.93
GHLC-S10	13.08	12.32	9.27	8.14	7.43	6.92	6.55	5.97	5.61	5.63 / 9.95

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。