

P S J 予測統計値
(中央値)

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	13.62	12.32	9.95	9.35	8.84	8.41	7.86	7.61	7.50	7.72 / 10.13	
JHF-2	13.80	12.36	9.96	9.37	8.85	8.27	7.84	7.51	7.34	7.71 / 10.06	
GHLC-1	12.96	11.99	9.61	8.30	7.44	6.94	6.52	5.90	5.38	5.23 / 9.12	
GHLC-2	13.02	11.89	9.50	8.19	7.45	6.93	6.54	5.92	5.43	5.33 / 9.24	
GHLC-3	13.31	12.21	9.45	8.26	7.47	6.92	6.61	5.94	5.44	5.39 / 9.22	
GHLC-4	12.61	11.48	9.04	7.97	7.32	6.84	6.48	5.81	5.50	5.60 / 9.00	
GHLC-5	12.69	11.34	8.82	7.90	7.28	6.79	6.43	5.88	5.56	5.71 / 8.96	
GHLC-6	12.91	11.54	8.89	7.97	7.36	6.83	6.46	5.79	5.59	5.84 / 8.96	
GHLC-7	12.86	11.63	8.85	7.91	7.29	6.91	6.43	5.76	5.58	5.89 / 8.82	
GHLC-8	12.74	11.30	8.90	7.99	7.33	6.84	6.49	5.80	5.61	5.92 / 8.82	
GHLC-9	12.52	11.17	8.86	7.91	7.31	6.69	6.53	5.81	5.62	5.90 / 8.74	
GHLC-10	12.49	11.57	8.78	7.75	7.25	6.74	6.53	5.80	5.62	5.98 / 8.64	
GHLC-11	12.06	11.03	8.66	7.62	7.14	6.68	6.56	5.84	5.66	6.01 / 8.49	
GHLC-12	11.84	10.65	8.44	7.53	7.02	6.79	6.45	5.84	5.67	6.14 / 8.54	
GHLC-13	12.49	10.67	8.72	7.76	7.14	6.83	6.42	5.84	5.67	6.20 / 8.74	
GHLC-14	11.95	10.91	8.63	7.62	7.09	6.82	6.43	5.85	5.68	6.10 / 8.21	
GHLC-15	11.89	10.90	8.62	7.59	7.06	6.81	6.44	5.85	5.68	6.14 / 8.30	
GHLC-16	12.19	11.10	8.65	7.64	7.07	6.81	6.45	5.85	5.68	6.19 / 8.60	
GHLC-17	12.10	10.96	8.65	7.72	7.06	6.84	6.46	5.88	5.70	6.18 / 8.39	
GHLC-18	12.12	10.46	8.63	7.70	7.10	6.84	6.43	5.86	5.70	6.14 / 8.53	
GHLC-19	12.14	10.62	8.66	7.70	7.08	6.85	6.42	5.87	5.72	6.25 / 8.47	
GHLC-20	11.86	10.66	8.59	7.56	6.98	6.87	6.51	5.88	5.73	6.25 / 8.27	
GHLC-21	12.05	10.75	8.53	7.65	7.09	6.91	6.51	5.94	5.81	6.39 / 8.62	
GHLC-22	12.10	10.58	8.62	7.59	7.14	6.92	6.53	5.94	5.81	6.41 / 8.31	
GHLC-23	12.16	10.66	8.60	7.61	7.13	6.90	6.57	5.95	5.83	6.41 / 8.43	
GHLC-24	12.01	11.00	8.54	7.58	7.15	6.88	6.54	5.99	5.87	6.46 / 8.40	
GHLC-25	11.62	10.83	8.45	7.49	7.05	6.82	6.52	6.00	5.88	6.46 / 8.39	
GHLC-26	11.67	10.60	8.19	7.42	7.03	6.84	6.41	5.93	5.80	6.38 / 8.76	
GHLC-27	10.96	10.18	8.01	7.28	7.06	6.79	6.31	6.04	5.93	5.80 / 8.37	
GHLC-28	11.81	10.58	8.25	7.38	6.98	6.79	6.49	5.99	5.87	6.43 / 8.36	
GHLC-29	10.93	10.10	8.08	7.34	7.09	6.77	6.33	6.08	5.95	5.60 / 8.72	
GHLC-30	10.80	9.95	8.08	7.36	7.06	6.75	6.31	6.13	6.00	5.33 / 9.49	
GHLC-31	10.95	9.85	7.95	7.28	6.99	6.68	6.28	6.06	5.94	5.22 / 8.80	
GHLC-32	10.49	9.76	7.64	7.21	6.94	6.65	6.32	6.06	5.94	5.04 / 8.31	
GHLC-33	10.92	9.95	7.83	7.21	6.98	6.71	6.39	6.08	5.96	5.42 / 8.42	
GHLC-34	10.59	9.78	7.64	7.17	6.94	6.66	6.32	6.07	5.96	5.08 / 8.39	
GHLC-35	10.58	9.82	7.72	7.16	6.85	6.61	6.38	6.09	5.97	5.24 / 8.32	
GHLC-36	11.18	10.09	7.95	7.34	7.03	6.73	6.44	6.13	6.01	5.98 / 8.68	
GHLC-37	11.02	10.02	7.88	7.25	6.93	6.70	6.41	6.12	5.99	5.82 / 8.50	
GHLC-38	11.29	10.26	8.07	7.36	6.95	6.69	6.46	6.12	6.00	6.27 / 8.40	
GHLC-39	11.14	10.12	7.98	7.34	7.03	6.71	6.47	6.15	6.02	6.16 / 8.85	
GHLC-40	11.75	10.59	8.27	7.44	7.06	6.79	6.52	6.15	6.02	6.35 / 8.63	
GHLC-41	11.07	10.10	8.06	7.36	6.96	6.61	6.41	6.16	6.03	6.29 / 8.90	
GHLC-42	11.75	10.55	8.25	7.44	7.13	6.78	6.60	6.22	6.08	6.35 / 9.34	
GHLC-43	12.19	10.94	8.41	7.49	7.19	6.77	6.53	6.19	6.06	6.42 / 8.53	
GHLC-44	12.90	11.68	8.70	7.81	7.29	6.94	6.57	6.24	6.10	6.54 / 8.63	
GHLC-45	12.74	11.25	8.55	7.71	7.28	6.84	6.58	6.25	6.11	6.47 / 8.90	
GHLC-46	12.62	11.39	8.60	7.77	7.32	6.91	6.58	6.25	6.11	6.51 / 9.27	
GHLC-47	12.68	11.41	8.61	7.81	7.37	6.94	6.55	6.27	6.13	6.51 / 9.16	
GHLC-48	12.29	10.81	8.30	7.55	7.22	6.79	6.62	6.25	6.10	6.39 / 8.98	
GHLC-49	12.09	10.79	8.29	7.57	7.23	6.74	6.53	6.23	6.08	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・ピッチ日本、大和SMBC、日興シエクレール

回号	Yield Curve Scenarios (%)									最低 / 最高 (%)	
	-300bp	-200bp	-100bp	-50bp	0bp	50bp	100bp	200bp	300bp		
GHLC-50	12.63	11.34	8.57	7.80	7.39	6.95	6.69	6.31	6.16	6.52 / 8.96	
GHLC-51	12.57	11.04	8.37	7.67	7.29	6.83	6.58	6.27	6.12	6.46 / 8.92	
GHLC-52	12.11	10.89	8.24	7.58	7.20	6.80	6.64	6.27	6.12	6.47 / 8.78	
GHLC-53	12.34	11.15	8.34	7.65	7.27	6.87	6.71	6.32	6.17	6.54 / 9.12	
JHF-S1	12.41	11.12	9.45	8.11	7.16	6.72	6.34	5.93	5.72	5.79 / 9.76	
GHLC-S1	12.54	11.61	9.40	8.18	7.32	6.86	6.47	5.86	5.52	5.32 / 9.51	
GHLC-S2	12.81	11.53	9.58	8.28	7.38	6.88	6.46	5.86	5.55	5.36 / 9.58	
GHLC-S3	12.69	11.72	9.63	8.32	7.42	6.87	6.48	5.91	5.57	5.39 / 9.65	
GHLC-S4	12.61	11.50	9.47	8.38	7.45	6.90	6.56	5.88	5.61	5.49 / 9.82	
GHLC-S5	12.95	11.80	9.44	8.32	7.42	6.99	6.56	5.86	5.59	5.48 / 9.82	
GHLC-S6	12.51	11.33	9.37	8.31	7.32	6.82	6.48	5.91	5.68	5.62 / 9.87	
GHLC-S7	12.44	11.22	9.38	8.20	7.31	6.82	6.49	5.91	5.69	5.61 / 9.89	
GHLC-S8	12.41	11.24	9.35	8.24	7.35	6.82	6.44	5.91	5.68	5.60 / 9.92	
GHLC-S9	12.35	11.19	9.34	8.07	7.34	6.81	6.40	5.92	5.69	5.58 / 9.92	
GHLC-S10	12.37	11.21	9.31	8.06	7.28	6.81	6.38	5.92	5.69	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。