

PSJ 予測統計値
(平均値)

2007年 9月 3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・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	16.03	14.82	10.97	9.78	8.98	8.51	8.12	7.58	7.23	7.90 / 10.24	
JHF-2	16.04	14.83	10.98	9.73	8.98	8.50	8.12	7.57	7.23	7.91 / 10.26	
JHF-3	16.22	15.00	10.99	9.80	8.98	8.52	8.15	7.60	7.24	7.92 / 10.27	
JHF-4	16.58	15.39	11.17	9.90	9.08	8.60	8.22	7.64	7.28	7.98 / 10.33	
JHF-5	17.06	15.83	11.26	9.92	9.08	8.57	8.20	7.60	7.24	7.82 / 10.34	
GHLC-1	13.78	13.20	10.35	8.78	7.69	6.97	6.52	5.94	5.57	5.54 / 9.18	
GHLC-2	13.80	13.25	10.32	8.77	7.70	7.00	6.55	5.98	5.61	5.61 / 9.23	
GHLC-3	13.94	13.40	10.36	8.78	7.73	7.05	6.60	6.03	5.67	5.68 / 9.20	
GHLC-4	13.25	12.67	9.77	8.40	7.53	6.97	6.56	6.04	5.68	5.83 / 9.02	
GHLC-5	13.12	12.56	9.67	8.37	7.52	6.96	6.56	6.03	5.68	5.95 / 8.96	
GHLC-6	13.28	12.68	9.75	8.42	7.57	7.02	6.61	6.09	5.73	6.08 / 8.94	
GHLC-7	13.38	12.75	9.80	8.48	7.64	7.07	6.66	6.13	5.78	6.13 / 8.91	
GHLC-8	13.36	12.76	9.74	8.45	7.61	7.05	6.64	6.12	5.76	6.17 / 8.89	
GHLC-9	13.01	12.36	9.58	8.29	7.51	6.97	6.57	6.07	5.71	6.12 / 8.84	
GHLC-10	12.86	12.23	9.53	8.30	7.51	7.00	6.61	6.11	5.76	6.21 / 8.78	
GHLC-11	12.74	12.04	9.33	8.13	7.42	6.93	6.57	6.07	5.73	6.22 / 8.66	
GHLC-12	12.48	11.84	9.16	8.02	7.38	6.92	6.58	6.11	5.77	6.33 / 8.48	
GHLC-13	12.71	12.04	9.26	8.10	7.44	6.97	6.61	6.14	5.80	6.37 / 8.72	
GHLC-14	12.72	12.07	9.24	8.11	7.41	6.94	6.58	6.09	5.76	6.30 / 8.42	
GHLC-15	12.76	12.08	9.25	8.07	7.41	6.94	6.58	6.11	5.77	6.35 / 8.45	
GHLC-16	12.66	12.00	9.16	8.09	7.41	6.95	6.60	6.12	5.79	6.38 / 8.48	
GHLC-17	12.63	11.90	9.13	8.05	7.40	6.94	6.59	6.11	5.79	6.38 / 8.38	
GHLC-18	12.59	11.86	9.11	8.06	7.39	6.94	6.59	6.13	5.80	6.32 / 8.42	
GHLC-19	12.61	11.87	9.11	8.00	7.40	6.95	6.61	6.14	5.81	6.44 / 8.44	
GHLC-20	12.89	12.14	9.32	8.20	7.44	6.96	6.61	6.14	5.80	6.44 / 8.66	
GHLC-21	12.90	12.15	9.33	8.23	7.48	7.01	6.67	6.20	5.87	6.60 / 8.60	
GHLC-22	12.99	12.30	9.35	8.21	7.46	6.98	6.64	6.16	5.83	6.60 / 8.47	
GHLC-23	13.11	12.36	9.40	8.22	7.48	7.01	6.66	6.17	5.84	6.61 / 8.58	
GHLC-24	13.21	12.43	9.39	8.29	7.50	7.02	6.68	6.18	5.85	6.66 / 8.95	
GHLC-25	13.04	12.24	9.32	8.18	7.46	6.99	6.65	6.16	5.83	6.67 / 9.09	
GHLC-26	12.50	11.70	9.09	8.01	7.36	6.93	6.61	6.15	5.83	6.57 / 8.57	
GHLC-27	12.33	11.46	8.95	7.96	7.33	6.92	6.60	6.15	5.85	6.67 / 9.05	
GHLC-28	12.71	11.88	9.12	8.07	7.39	6.94	6.61	6.14	5.82	6.65 / 9.16	
GHLC-29	12.21	11.31	8.89	7.95	7.34	6.94	6.62	6.18	5.88	6.63 / 8.73	
GHLC-30	12.12	11.25	8.98	7.98	7.42	7.04	6.71	6.27	5.96	6.62 / 9.36	
GHLC-31	11.90	10.99	8.75	7.88	7.31	6.93	6.61	6.19	5.89	6.51 / 8.81	
GHLC-32	11.54	10.68	8.62	7.74	7.22	6.84	6.54	6.12	5.84	6.45 / 8.87	
GHLC-33	12.07	11.20	8.81	7.87	7.31	6.93	6.60	6.17	5.86	6.54 / 9.02	
GHLC-34	11.57	10.66	8.61	7.77	7.21	6.85	6.55	6.13	5.84	6.41 / 8.71	
GHLC-35	11.72	10.75	8.57	7.71	7.21	6.85	6.55	6.12	5.82	6.44 / 8.61	
GHLC-36	12.33	11.37	8.89	7.92	7.34	6.97	6.65	6.20	5.89	6.56 / 8.61	
GHLC-37	12.10	11.19	8.78	7.83	7.30	6.94	6.62	6.18	5.87	6.53 / 8.56	
GHLC-38	12.60	11.70	8.96	7.96	7.34	6.96	6.64	6.18	5.87	6.58 / 8.62	
GHLC-39	12.47	11.52	8.95	7.98	7.39	7.01	6.68	6.22	5.91	6.53 / 8.80	
GHLC-40	13.12	12.15	9.20	8.07	7.45	7.06	6.72	6.24	5.92	6.66 / 8.62	
GHLC-41	12.60	11.63	8.99	7.99	7.38	6.99	6.67	6.21	5.90	6.56 / 8.85	
GHLC-42	13.35	12.38	9.35	8.28	7.56	7.13	6.79	6.30	5.98	6.64 / 9.26	
GHLC-43	13.90	12.96	9.44	8.34	7.55	7.11	6.75	6.25	5.92	6.75 / 9.24	
GHLC-44	14.79	13.85	9.91	8.57	7.72	7.21	6.87	6.31	5.97	6.91 / 9.31	
GHLC-45	14.48	13.50	9.75	8.47	7.68	7.20	6.85	6.32	5.98	6.80 / 9.16	
GHLC-46	14.66	13.65	9.85	8.50	7.69	7.20	6.85	6.31	5.97	6.81 / 9.23	

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

回号	Yield Curve Scenarios (%)									最低 / 最高 (%)	
	-300bp	-200bp	-100bp	-50bp	0bp	50bp	100bp	200bp	300bp		
GHLC-47	14.75	13.72	9.93	8.52	7.71	7.20	6.85	6.30	5.95	6.81 /	9.68
GHLC-48	13.83	12.79	9.53	8.32	7.60	7.13	6.79	6.28	5.95	6.63 /	9.56
GHLC-49	13.86	12.84	9.49	8.30	7.57	7.10	6.76	6.25	5.92	6.65 /	9.64
GHLC-50	14.90	13.86	10.00	8.66	7.79	7.27	6.90	6.34	5.99	6.81 /	9.73
GHLC-51	14.34	13.24	9.69	8.41	7.66	7.18	6.80	6.28	5.93	6.71 /	9.76
GHLC-52	13.97	12.87	9.52	8.36	7.61	7.16	6.79	6.29	5.95	6.71 /	9.44
GHLC-53	14.36	13.20	9.56	8.44	7.64	7.21	6.86	6.34	6.00	6.79 /	9.00
JHF-S1	13.19	12.65	9.77	8.52	7.61	7.05	6.64	6.13	5.79	5.99 /	9.76
JHF-S2	13.21	12.61	9.76	8.47	7.60	7.05	6.63	6.13	5.79	5.99 /	9.78
JHF-S3	13.24	12.67	9.78	8.49	7.62	7.07	6.66	6.15	5.80	5.99 /	9.80
GHLC-S1	13.51	12.95	10.11	8.69	7.64	6.95	6.50	5.94	5.57	5.60 /	9.15
GHLC-S2	13.47	12.93	10.12	8.65	7.63	6.94	6.50	5.94	5.57	5.66 /	9.22
GHLC-S3	13.49	12.97	10.14	8.71	7.64	6.97	6.52	5.96	5.59	5.66 /	9.25
GHLC-S4	13.45	12.87	10.06	8.60	7.66	7.06	6.64	6.09	5.73	5.73 /	9.57
GHLC-S5	13.48	12.89	10.04	8.59	7.66	7.07	6.65	6.09	5.74	5.71 /	9.58
GHLC-S6	13.33	12.73	9.87	8.53	7.64	7.06	6.65	6.11	5.76	5.86 /	9.79
GHLC-S7	13.32	12.72	9.92	8.54	7.63	7.06	6.65	6.11	5.76	5.84 /	9.80
GHLC-S8	13.32	12.72	9.87	8.53	7.62	7.05	6.64	6.10	5.75	5.85 /	9.84
GHLC-S9	13.25	12.68	9.86	8.47	7.61	7.04	6.63	6.10	5.75	5.82 /	9.85
GHLC-S10	13.25	12.70	9.85	8.49	7.61	7.04	6.63	6.10	5.75	5.83 /	9.87

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。