

P S J 予測統計値
(中央値)

2007年 9月 18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	14.04	13.22	10.56	9.52	9.02	8.33	7.97	7.50	7.28	7.80 / 10.26		
JHF-2	14.07	13.48	10.42	9.53	9.04	8.34	7.97	7.56	7.34	7.83 / 10.25		
JHF-3	14.19	13.70	10.48	9.59	9.10	8.41	7.98	7.57	7.36	7.87 / 10.28		
JHF-4	14.20	13.82	10.58	9.67	9.14	8.51	8.01	7.62	7.40	7.91 / 10.35		
JHF-5	14.67	14.29	10.45	9.66	9.21	8.55	8.00	7.52	7.35	7.93 / 10.05		
GHLC-1	13.16	12.72	10.56	9.32	8.09	7.21	6.65	5.94	5.37	5.60 / 9.39		
GHLC-2	13.11	12.85	10.52	9.06	8.11	7.26	6.70	5.98	5.43	5.66 / 9.43		
GHLC-3	13.21	12.99	10.64	9.23	8.13	7.30	6.71	5.98	5.44	5.73 / 9.35		
GHLC-4	12.88	12.36	9.71	8.75	7.79	7.09	6.55	5.89	5.49	5.87 / 9.03		
GHLC-5	12.95	12.51	9.48	8.69	7.71	7.07	6.58	5.87	5.53	5.95 / 8.95		
GHLC-6	12.95	12.39	9.62	8.73	7.83	7.15	6.58	5.94	5.59	6.08 / 8.94		
GHLC-7	13.03	12.40	9.89	8.65	7.76	7.08	6.62	5.91	5.56	6.12 / 9.01		
GHLC-8	13.02	12.43	9.78	8.71	7.82	7.14	6.63	5.96	5.60	6.17 / 8.90		
GHLC-9	12.79	12.29	9.56	8.43	7.71	7.07	6.54	5.94	5.63	6.16 / 8.83		
GHLC-10	12.64	12.24	9.71	8.50	7.71	6.99	6.53	5.91	5.64	6.24 / 8.80		
GHLC-11	12.39	12.12	9.49	8.47	7.66	6.93	6.47	5.92	5.66	6.24 / 8.69		
GHLC-12	11.96	11.83	9.50	8.34	7.53	7.00	6.41	5.91	5.68	6.35 / 8.60		
GHLC-13	12.31	12.11	9.51	8.50	7.66	6.95	6.44	5.92	5.69	6.41 / 8.89		
GHLC-14	12.22	12.19	9.63	8.42	7.61	6.96	6.46	5.94	5.69	6.32 / 8.47		
GHLC-15	12.20	12.15	9.57	8.40	7.59	6.92	6.45	5.94	5.68	6.37 / 8.50		
GHLC-16	12.24	12.09	9.62	8.30	7.56	6.98	6.43	5.93	5.69	6.38 / 8.64		
GHLC-17	12.19	12.07	9.43	8.36	7.55	6.96	6.44	5.95	5.71	6.40 / 8.43		
GHLC-18	12.07	11.78	9.23	8.42	7.53	6.96	6.42	5.95	5.71	6.37 / 8.58		
GHLC-19	12.06	11.78	9.22	8.44	7.54	6.94	6.43	5.96	5.75	6.47 / 8.60		
GHLC-20	12.15	11.98	9.45	8.44	7.53	6.98	6.43	5.97	5.77	6.48 / 8.81		
GHLC-21	12.47	11.86	9.42	8.37	7.62	6.97	6.45	6.00	5.86	6.59 / 8.75		
GHLC-22	12.49	12.07	9.48	8.44	7.54	6.96	6.48	6.01	5.85	6.63 / 8.64		
GHLC-23	12.64	12.13	9.54	8.43	7.52	6.98	6.50	6.03	5.87	6.63 / 8.60		
GHLC-24	12.54	12.07	9.45	8.38	7.48	6.96	6.52	6.04	5.92	6.68 / 9.11		
GHLC-25	12.25	11.94	9.27	8.23	7.39	6.87	6.54	6.07	5.94	6.70 / 9.23		
GHLC-26	11.81	11.41	9.07	8.06	7.38	6.85	6.44	5.99	5.86	6.58 / 8.74		
GHLC-27	11.64	11.17	8.91	7.94	7.31	6.75	6.46	6.12	6.00	6.62 / 9.20		
GHLC-28	12.09	11.56	9.04	7.99	7.27	6.81	6.49	6.06	5.93	6.64 / 9.55		
GHLC-29	11.43	10.94	8.74	7.98	7.35	6.78	6.47	6.14	6.01	6.62 / 8.89		
GHLC-30	11.49	10.57	8.62	7.89	7.33	6.79	6.53	6.20	6.07	6.63 / 9.53		
GHLC-31	11.24	10.45	8.55	7.83	7.23	6.76	6.44	6.15	6.02	6.54 / 8.97		
GHLC-32	10.74	10.25	8.46	7.65	7.06	6.77	6.39	6.14	6.02	6.47 / 9.03		
GHLC-33	11.26	10.65	8.61	7.77	7.20	6.84	6.46	6.17	6.04	6.60 / 9.18		
GHLC-34	10.75	10.36	8.42	7.59	7.05	6.80	6.40	6.14	6.01	6.44 / 8.88		
GHLC-35	10.79	10.48	8.31	7.49	7.04	6.75	6.42	6.16	6.03	6.46 / 8.77		
GHLC-36	11.60	10.72	8.71	7.86	7.27	6.86	6.52	6.20	6.06	6.61 / 8.77		
GHLC-37	11.53	10.80	8.63	7.71	7.17	6.87	6.50	6.20	6.06	6.57 / 8.73		
GHLC-38	11.93	10.94	8.75	7.77	7.20	6.84	6.54	6.21	6.08	6.67 / 8.79		
GHLC-39	11.70	10.89	8.72	7.85	7.27	6.93	6.55	6.24	6.10	6.61 / 8.96		
GHLC-40	12.50	11.44	9.08	8.05	7.34	6.93	6.59	6.22	6.08	6.74 / 8.78		
GHLC-41	11.58	10.92	8.70	7.74	7.20	6.84	6.49	6.23	6.10	6.62 / 9.02		
GHLC-42	12.46	11.26	9.04	8.08	7.40	6.98	6.66	6.30	6.14	6.71 / 9.42		
GHLC-43	12.70	12.06	9.20	8.10	7.34	7.02	6.64	6.27	6.12	6.82 / 9.41		
GHLC-44	13.07	12.83	9.54	8.42	7.51	7.10	6.70	6.32	6.17	7.00 / 9.47		
GHLC-45	12.74	12.31	9.44	8.34	7.47	7.05	6.69	6.33	6.18	6.88 / 9.33		
GHLC-46	12.90	12.54	9.46	8.35	7.48	7.04	6.75	6.32	6.17	6.89 / 9.48		

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、日興シtyグループ

回号	Yield Curve Scenarios (%)									最低 / 最高 (%)	
	-300bp	-200bp	-100bp	-50bp	0bp	50bp	100bp	200bp	300bp		
GHLC-47	12.89	12.53	9.46	8.37	7.53	7.07	6.74	6.34	6.19	6.90 /	9.70
GHLC-48	12.30	12.02	9.13	8.10	7.38	7.00	6.69	6.32	6.18	6.69 /	9.69
GHLC-49	12.30	11.89	9.00	8.10	7.39	7.01	6.61	6.31	6.17	6.71 /	9.78
GHLC-50	13.14	12.51	9.49	8.34	7.55	7.09	6.80	6.39	6.24	6.87 /	9.84
GHLC-51	12.54	12.12	9.14	8.13	7.45	7.06	6.70	6.35	6.19	6.77 /	9.92
GHLC-52	12.67	11.76	9.07	8.02	7.36	7.02	6.69	6.34	6.19	6.76 /	9.87
GHLC-53	12.67	12.05	9.27	8.10	7.43	7.09	6.73	6.40	6.24	6.84 /	9.17
JHF-S1	12.64	12.03	9.98	8.96	7.74	6.96	6.58	5.92	5.69	5.97 /	9.72
JHF-S2	12.65	12.04	9.81	8.96	7.72	6.95	6.57	5.92	5.68	5.97 /	9.75
JHF-S3	12.72	12.13	9.93	8.96	7.76	6.95	6.54	5.95	5.69	5.98 /	9.80
GHLC-S1	12.80	12.39	10.13	9.17	7.89	7.07	6.58	6.00	5.46	5.67 /	9.29
GHLC-S2	12.81	12.24	10.46	9.18	8.05	7.15	6.59	6.00	5.48	5.67 /	9.35
GHLC-S3	12.70	12.25	10.45	9.20	8.08	7.19	6.61	6.02	5.51	5.72 /	9.39
GHLC-S4	12.76	12.24	10.24	9.10	8.18	7.16	6.60	5.98	5.55	5.78 /	9.56
GHLC-S5	12.84	12.50	10.45	8.98	8.15	7.17	6.71	5.98	5.54	5.75 /	9.58
GHLC-S6	12.65	12.12	10.03	8.75	8.06	7.04	6.56	5.93	5.62	5.87 /	9.76
GHLC-S7	12.64	12.12	10.04	9.07	8.01	7.01	6.57	5.93	5.63	5.87 /	9.80
GHLC-S8	12.62	12.08	10.05	8.78	7.97	7.01	6.55	5.93	5.62	5.85 /	9.82
GHLC-S9	12.59	12.07	10.06	8.75	7.93	6.98	6.55	5.94	5.63	5.87 /	9.83
GHLC-S10	12.58	12.07	10.05	8.99	7.90	6.99	6.55	5.94	5.62	5.85 /	9.85

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。