

P S J 予測統計値  
(中央値)

2007年 10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・スタール,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	13.93	13.21	10.19	9.30	8.92	8.18	7.87	7.41	7.23	7.77 / 10.19	
JHF-2	13.73	13.34	10.12	9.31	8.94	8.20	7.88	7.42	7.25	7.78 / 10.21	
JHF-3	13.89	13.27	10.17	9.39	8.99	8.22	7.85	7.43	7.27	7.83 / 10.23	
JHF-4	14.09	13.66	10.25	9.48	9.03	8.33	7.91	7.48	7.29	7.87 / 10.28	
JHF-5	14.61	14.03	10.40	9.59	9.10	8.34	7.83	7.39	7.26	7.79 / 10.35	
JHF-6	14.33	13.78	10.34	9.38	8.96	8.28	7.82	7.34	7.21	7.59 / 10.30	
GHLC-1	13.42	12.78	10.21	8.97	7.84	7.12	6.57	5.93	5.38	5.42 / 8.89	
GHLC-2	13.21	12.70	10.17	8.89	7.84	7.14	6.54	5.94	5.39	5.48 / 9.07	
GHLC-3	13.30	12.92	10.33	8.91	7.88	7.13	6.54	5.95	5.42	5.54 / 9.06	
GHLC-4	13.04	12.45	9.44	8.59	7.56	7.00	6.48	5.89	5.44	5.73 / 9.04	
GHLC-5	13.28	12.41	9.24	8.50	7.50	6.95	6.52	5.84	5.49	5.84 / 8.95	
GHLC-6	13.14	12.54	9.35	8.47	7.60	7.00	6.51	5.89	5.55	5.99 / 8.93	
GHLC-7	13.08	12.50	9.57	8.38	7.54	6.98	6.58	5.87	5.54	6.02 / 8.89	
GHLC-8	13.16	12.37	9.46	8.45	7.60	6.98	6.58	5.91	5.57	6.08 / 8.88	
GHLC-9	12.94	12.24	9.19	8.23	7.51	6.94	6.49	5.88	5.61	6.04 / 8.83	
GHLC-10	12.78	12.34	9.40	8.45	7.52	6.92	6.54	5.83	5.61	6.13 / 8.78	
GHLC-11	12.45	12.03	9.20	8.29	7.46	6.90	6.47	5.86	5.64	6.15 / 8.67	
GHLC-12	12.04	11.86	9.17	8.11	7.38	6.93	6.38	5.85	5.66	6.25 / 8.55	
GHLC-13	12.34	12.13	9.19	8.30	7.54	6.87	6.40	5.87	5.67	6.32 / 8.74	
GHLC-14	12.33	12.18	9.31	8.18	7.46	6.84	6.46	5.89	5.67	6.23 / 8.39	
GHLC-15	12.30	12.08	9.27	8.17	7.43	6.85	6.43	5.88	5.67	6.29 / 8.43	
GHLC-16	12.31	12.11	9.19	8.13	7.41	6.92	6.42	5.88	5.67	6.31 / 8.60	
GHLC-17	12.21	12.00	9.08	8.11	7.40	6.86	6.41	5.90	5.69	6.32 / 8.37	
GHLC-18	12.07	11.72	9.03	8.17	7.41	6.89	6.40	5.89	5.70	6.27 / 8.44	
GHLC-19	12.02	11.68	9.00	8.09	7.41	6.87	6.37	5.90	5.72	6.38 / 8.46	
GHLC-20	12.21	11.73	9.15	8.19	7.35	6.89	6.39	5.92	5.74	6.38 / 8.50	
GHLC-21	12.49	11.80	9.23	8.18	7.46	6.89	6.42	5.95	5.82	6.53 / 8.63	
GHLC-22	12.58	11.98	9.23	8.15	7.38	6.87	6.50	5.95	5.82	6.52 / 8.45	
GHLC-23	12.70	11.99	9.25	8.19	7.35	6.86	6.49	5.98	5.84	6.56 / 8.54	
GHLC-24	12.56	11.82	9.13	8.14	7.32	6.86	6.49	6.01	5.88	6.60 / 8.79	
GHLC-25	12.26	11.42	9.03	8.00	7.23	6.80	6.49	6.04	5.92	6.61 / 8.95	
GHLC-26	11.86	11.50	8.86	7.84	7.25	6.77	6.38	5.95	5.82	6.51 / 8.42	
GHLC-27	11.31	10.83	8.63	7.75	7.19	6.71	6.39	6.09	5.97	6.57 / 8.87	
GHLC-28	12.02	11.36	8.84	7.76	7.16	6.77	6.40	6.02	5.90	6.57 / 9.07	
GHLC-29	11.38	10.96	8.53	7.80	7.25	6.72	6.38	6.11	5.99	6.56 / 8.65	
GHLC-30	11.48	10.36	8.42	7.74	7.21	6.72	6.43	6.16	6.03	6.53 / 9.42	
GHLC-31	11.01	10.54	8.35	7.68	7.11	6.66	6.34	6.11	5.98	6.42 / 8.82	
GHLC-32	10.72	10.24	8.26	7.48	6.97	6.67	6.30	6.11	6.00	6.36 / 8.68	
GHLC-33	11.27	10.81	8.43	7.59	7.10	6.76	6.36	6.14	6.01	6.47 / 8.83	
GHLC-34	10.77	10.39	8.18	7.43	7.00	6.67	6.33	6.13	6.02	6.35 / 8.52	
GHLC-35	10.82	10.39	8.10	7.35	6.98	6.68	6.32	6.12	6.01	6.35 / 8.44	
GHLC-36	11.63	10.78	8.48	7.66	7.17	6.78	6.42	6.17	6.04	6.50 / 8.60	
GHLC-37	11.20	10.56	8.38	7.51	7.06	6.77	6.41	6.17	6.05	6.44 / 8.51	
GHLC-38	11.75	11.10	8.52	7.58	7.10	6.79	6.44	6.18	6.05	6.55 / 8.53	
GHLC-39	11.56	10.70	8.47	7.64	7.17	6.86	6.46	6.21	6.08	6.48 / 8.85	
GHLC-40	12.41	11.59	8.79	7.81	7.21	6.91	6.51	6.20	6.07	6.62 / 8.63	
GHLC-41	11.36	10.79	8.48	7.55	7.10	6.76	6.42	6.21	6.07	6.50 / 8.82	
GHLC-42	12.02	11.23	8.79	7.86	7.27	6.90	6.56	6.27	6.12	6.60 / 9.25	
GHLC-43	12.35	11.44	8.91	7.89	7.24	6.96	6.57	6.25	6.10	6.69 / 9.03	
GHLC-44	13.04	12.62	9.36	8.23	7.37	7.02	6.61	6.29	6.15	6.86 / 9.09	
GHLC-45	12.71	12.28	9.19	8.13	7.36	6.98	6.63	6.30	6.16	6.75 / 8.95	

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・リンチ・ピエール・オレン、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		
GHLC-46	12.78	12.22	9.17	8.13	7.37	6.99	6.67	6.31	6.16	6.75 /	9.02
GHLC-47	12.86	12.29	9.11	8.15	7.41	7.00	6.66	6.32	6.16	6.76 /	9.48
GHLC-48	12.26	11.46	8.72	7.90	7.26	6.94	6.60	6.30	6.15	6.58 /	9.46
GHLC-49	12.32	11.69	8.70	7.90	7.27	6.96	6.54	6.29	6.14	6.59 /	9.55
GHLC-50	12.84	12.28	9.20	8.12	7.42	7.03	6.74	6.36	6.21	6.75 /	9.62
GHLC-51	12.59	12.09	8.78	7.93	7.33	7.00	6.60	6.33	6.18	6.65 /	9.77
GHLC-52	12.66	11.78	8.66	7.83	7.25	6.93	6.60	6.33	6.18	6.64 /	9.64
GHLC-53	12.83	11.78	8.84	7.90	7.34	7.01	6.65	6.37	6.21	6.72 /	9.07
JHF-S1	12.79	11.98	9.98	8.71	7.56	6.84	6.51	5.89	5.64	5.90 /	9.71
JHF-S2	12.78	11.95	9.66	8.72	7.53	6.82	6.52	5.88	5.63	5.90 /	9.73
JHF-S3	12.80	12.00	9.70	8.70	7.54	6.83	6.52	5.92	5.63	5.91 /	9.80
GHLC-S1	12.89	12.17	9.98	8.83	7.65	6.98	6.48	5.97	5.40	5.49 /	9.03
GHLC-S2	12.82	12.12	10.26	8.89	7.76	7.04	6.50	5.97	5.40	5.54 /	9.09
GHLC-S3	12.90	12.19	10.26	8.82	7.80	7.03	6.50	6.00	5.44	5.56 /	9.16
GHLC-S4	12.84	12.18	10.09	8.80	7.88	7.05	6.51	5.97	5.49	5.62 /	9.54
GHLC-S5	12.88	12.55	10.12	8.78	7.87	7.02	6.69	5.96	5.49	5.59 /	9.55
GHLC-S6	12.79	12.05	9.92	8.62	7.86	6.92	6.48	5.93	5.57	5.73 /	9.77
GHLC-S7	12.79	12.04	9.94	8.61	7.81	6.90	6.49	5.93	5.58	5.73 /	9.80
GHLC-S8	12.76	12.00	9.88	8.86	7.79	6.88	6.48	5.92	5.57	5.73 /	9.82
GHLC-S9	12.70	11.99	9.96	8.48	7.73	6.85	6.46	5.92	5.57	5.71 /	9.83
GHLC-S10	12.69	11.97	9.96	8.83	7.71	6.85	6.48	5.92	5.57	5.71 /	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。