

P S J 予測統計値
(中央値)

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,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	13.55	12.85	9.96	9.28	8.94	8.13	7.84	7.60	7.47	7.77 / 10.16	
JHF-2	13.75	12.83	9.97	9.31	8.99	8.17	7.87	7.63	7.51	7.79 / 10.18	
JHF-3	13.78	13.05	10.03	9.38	9.05	8.23	7.79	7.58	7.39	7.83 / 10.21	
JHF-4	14.16	13.23	10.10	9.47	9.10	8.27	7.85	7.64	7.48	7.72 / 10.18	
GHLC-1	13.14	12.28	9.95	8.55	7.61	7.07	6.46	5.75	5.37	5.28 / 8.95	
GHLC-2	12.99	12.16	9.89	8.53	7.65	7.03	6.46	5.78	5.39	5.36 / 9.09	
GHLC-3	13.33	12.50	9.85	8.52	7.59	7.04	6.47	5.83	5.40	5.42 / 9.14	
GHLC-4	13.03	11.63	9.20	8.21	7.42	6.90	6.48	5.81	5.47	5.64 / 9.02	
GHLC-5	12.91	11.80	9.00	8.14	7.41	6.87	6.46	5.77	5.52	5.76 / 8.94	
GHLC-6	12.96	11.57	9.05	8.22	7.46	6.92	6.51	5.80	5.57	5.88 / 8.95	
GHLC-7	12.89	11.89	9.07	8.15	7.40	6.97	6.50	5.77	5.55	5.96 / 8.89	
GHLC-8	12.78	11.72	9.05	8.23	7.47	6.92	6.49	5.80	5.59	5.99 / 8.87	
GHLC-9	12.70	11.45	8.89	8.08	7.33	6.82	6.38	5.81	5.61	5.97 / 8.81	
GHLC-10	12.57	11.59	8.94	8.06	7.36	6.77	6.35	5.81	5.61	6.06 / 8.73	
GHLC-11	12.19	11.67	8.87	7.87	7.28	6.65	6.37	5.84	5.63	6.09 / 8.57	
GHLC-12	11.84	11.17	8.70	7.67	7.07	6.66	6.39	5.84	5.67	6.21 / 8.35	
GHLC-13	11.93	11.42	8.79	7.99	7.29	6.60	6.41	5.85	5.68	6.26 / 8.61	
GHLC-14	12.11	11.28	8.81	7.87	7.23	6.68	6.41	5.86	5.68	6.17 / 8.31	
GHLC-15	11.92	11.27	8.80	7.81	7.20	6.68	6.39	5.85	5.67	6.22 / 8.35	
GHLC-16	11.93	11.06	8.81	7.83	7.21	6.64	6.39	5.86	5.67	6.26 / 8.38	
GHLC-17	12.14	11.01	8.82	7.92	7.19	6.64	6.42	5.88	5.68	6.26 / 8.28	
GHLC-18	12.15	11.08	8.87	7.86	7.23	6.64	6.42	5.87	5.69	6.23 / 8.32	
GHLC-19	12.15	11.18	8.88	7.84	7.22	6.63	6.43	5.89	5.74	6.33 / 8.35	
GHLC-20	12.09	11.05	8.79	7.76	7.12	6.73	6.41	5.89	5.77	6.34 / 8.34	
GHLC-21	12.08	10.85	8.83	7.76	7.19	6.74	6.40	5.96	5.84	6.49 / 8.42	
GHLC-22	12.12	11.22	8.83	7.73	7.13	6.78	6.44	5.96	5.84	6.49 / 8.38	
GHLC-23	12.17	11.14	8.83	7.72	7.13	6.78	6.46	5.99	5.86	6.51 / 8.56	
GHLC-24	12.01	11.13	8.78	7.68	7.11	6.79	6.46	6.03	5.90	6.56 / 9.08	
GHLC-25	11.75	10.78	8.66	7.58	7.05	6.77	6.43	6.05	5.93	6.57 / 8.48	
GHLC-26	11.77	10.75	8.46	7.49	6.93	6.76	6.31	5.96	5.84	6.46 / 9.01	
GHLC-27	11.10	10.33	8.26	7.45	6.96	6.70	6.32	6.09	5.98	6.13 / 8.45	
GHLC-28	11.57	10.79	8.44	7.43	6.88	6.80	6.35	6.03	5.92	6.55 / 8.42	
GHLC-29	11.13	10.25	8.24	7.53	6.99	6.66	6.32	6.11	6.00	5.93 / 8.54	
GHLC-30	10.59	10.09	8.22	7.46	7.03	6.67	6.37	6.17	6.04	5.69 / 9.30	
GHLC-31	11.07	9.99	8.10	7.27	7.00	6.65	6.30	6.13	6.00	5.35 / 8.71	
GHLC-32	10.62	9.86	7.89	7.13	6.99	6.61	6.28	6.12	6.00	5.09 / 8.35	
GHLC-33	11.02	10.09	8.03	7.32	6.97	6.71	6.31	6.14	6.01	5.56 / 8.42	
GHLC-34	10.60	9.91	7.78	7.08	6.93	6.65	6.30	6.13	6.00	5.27 / 8.34	
GHLC-35	10.57	9.99	7.84	7.11	6.87	6.65	6.32	6.14	6.01	5.49 / 8.38	
GHLC-36	11.02	10.25	8.11	7.38	7.02	6.76	6.36	6.18	6.05	6.35 / 8.49	
GHLC-37	11.02	10.17	8.02	7.29	6.94	6.74	6.36	6.18	6.05	6.02 / 8.41	
GHLC-38	11.31	10.42	8.23	7.39	6.98	6.74	6.39	6.19	6.06	6.38 / 8.68	
GHLC-39	11.36	10.28	8.14	7.36	7.03	6.76	6.40	6.21	6.07	6.33 / 8.66	
GHLC-40	11.76	10.78	8.44	7.50	7.05	6.84	6.44	6.20	6.06	6.44 / 8.67	
GHLC-41	11.06	10.35	8.21	7.37	6.98	6.71	6.39	6.21	6.07	6.38 / 8.71	
GHLC-42	11.93	10.71	8.49	7.54	7.13	6.82	6.51	6.27	6.13	6.43 / 9.13	
GHLC-43	12.32	11.27	8.57	7.62	7.11	6.79	6.52	6.25	6.12	6.52 / 8.85	
GHLC-44	12.94	12.26	8.89	7.95	7.22	7.00	6.59	6.30	6.16	6.66 / 9.45	
GHLC-45	12.53	11.64	8.73	7.86	7.19	6.95	6.59	6.30	6.16	6.56 / 10.12	
GHLC-46	12.80	11.92	8.76	7.91	7.23	6.98	6.60	6.30	6.16	6.59 / 10.19	
GHLC-47	12.86	11.94	8.76	7.93	7.27	7.01	6.58	6.32	6.18	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、日興フィグループ

回号	Yield Curve Scenarios (%)									最低 / 最高 (%)
	-300bp	-200bp	-100bp	-50bp	0bp	50bp	100bp	200bp	300bp	
GHLC-48	12.22	11.12	8.46	7.66	7.19	6.86	6.56	6.31	6.17	6.46 / 10.16
GHLC-49	12.07	11.14	8.46	7.67	7.20	6.84	6.52	6.30	6.16	6.48 / 9.53
GHLC-50	12.71	11.91	8.73	7.90	7.31	7.02	6.64	6.37	6.22	6.62 / 9.18
GHLC-51	12.46	11.34	8.52	7.76	7.26	6.92	6.54	6.32	6.17	6.52 / 9.41
GHLC-52	12.36	11.07	8.40	7.62	7.21	6.87	6.55	6.33	6.18	6.53 / 9.28
GHLC-53	12.58	11.35	8.47	7.74	7.26	6.93	6.58	6.38	6.22	6.61 / 9.15
JHF-S1	12.44	11.26	9.69	8.42	7.32	6.72	6.47	5.92	5.69	5.85 / 9.73
JHF-S2	12.45	11.26	9.46	8.42	7.30	6.73	6.48	5.93	5.69	5.85 / 9.75
GHLC-S1	12.57	11.87	9.84	8.49	7.45	7.00	6.42	5.80	5.48	5.38 / 9.31
GHLC-S2	12.66	11.76	10.01	8.64	7.53	6.99	6.43	5.82	5.50	5.41 / 9.38
GHLC-S3	12.70	11.82	10.00	8.55	7.58	6.99	6.45	5.84	5.52	5.43 / 9.47
GHLC-S4	12.58	11.85	9.83	8.56	7.51	6.97	6.51	5.85	5.57	5.51 / 9.74
GHLC-S5	12.92	12.20	9.81	8.45	7.46	6.99	6.58	5.86	5.56	5.51 / 9.74
GHLC-S6	12.53	11.47	9.62	8.66	7.54	6.85	6.47	5.88	5.65	5.66 / 9.87
GHLC-S7	12.48	11.46	9.62	8.59	7.51	6.82	6.47	5.87	5.66	5.65 / 9.88
GHLC-S8	12.55	11.38	9.61	8.59	7.54	6.79	6.47	5.87	5.65	5.65 / 9.92
GHLC-S9	12.53	11.30	9.60	8.44	7.50	6.79	6.44	5.87	5.66	5.62 / 9.93
GHLC-S10	12.34	11.32	9.58	8.49	7.47	6.79	6.45	5.87	5.66	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。