

P S J 予測統計値  
(平均値)

2007年 11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,メルガン・スチール,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	15.69	14.68	10.96	9.78	8.98	8.48	8.09	7.54	7.20	7.83 / 10.23		
JHF-2	15.66	14.66	10.96	9.75	8.97	8.47	8.09	7.55	7.20	7.84 / 10.23		
JHF-3	15.90	14.88	11.02	9.81	8.99	8.48	8.10	7.55	7.20	7.90 / 10.24		
JHF-4	16.25	15.19	11.23	9.95	9.08	8.56	8.18	7.62	7.26	7.93 / 10.30		
JHF-5	16.68	15.62	11.45	9.98	9.10	8.54	8.15	7.54	7.18	7.98 / 10.38		
JHF-6	16.44	15.35	11.24	9.89	9.03	8.49	8.10	7.52	7.16	7.79 / 10.38		
JHF-7	15.64	14.55	10.85	9.70	8.97	8.49	8.10	7.54	7.20	7.80 / 10.29		
GHLC-1	13.79	13.28	10.73	9.07	7.84	7.04	6.55	5.96	5.59	5.53 / 9.52		
GHLC-2	13.82	13.26	10.66	9.01	7.80	7.05	6.57	5.99	5.63	5.62 / 9.04		
GHLC-3	13.79	13.25	10.56	8.93	7.78	7.07	6.59	6.02	5.66	5.67 / 9.09		
GHLC-4	13.25	12.75	10.06	8.57	7.62	7.01	6.58	6.04	5.70	5.66 / 9.04		
GHLC-5	13.21	12.67	9.99	8.60	7.62	7.01	6.59	6.06	5.71	5.73 / 8.93		
GHLC-6	13.41	12.88	10.09	8.68	7.69	7.07	6.65	6.11	5.76	5.84 / 8.93		
GHLC-7	13.46	12.89	10.09	8.69	7.72	7.12	6.69	6.15	5.80	5.86 / 9.12		
GHLC-8	13.46	12.93	10.07	8.71	7.72	7.12	6.69	6.15	5.79	5.94 / 8.87		
GHLC-9	13.12	12.51	9.85	8.53	7.60	7.03	6.61	6.09	5.75	5.97 / 8.82		
GHLC-10	12.93	12.31	9.78	8.42	7.59	7.04	6.64	6.13	5.78	6.02 / 8.79		
GHLC-11	12.76	12.16	9.53	8.34	7.50	6.98	6.59	6.09	5.75	6.06 / 8.70		
GHLC-12	12.59	11.99	9.34	8.19	7.45	6.96	6.60	6.12	5.79	6.15 / 8.73		
GHLC-13	12.77	12.18	9.46	8.26	7.51	7.00	6.63	6.14	5.81	6.18 / 8.92		
GHLC-14	12.86	12.27	9.51	8.31	7.49	6.98	6.59	6.10	5.77	6.15 / 8.48		
GHLC-15	12.80	12.21	9.44	8.26	7.48	6.98	6.60	6.11	5.78	6.17 / 8.51		
GHLC-16	12.75	12.11	9.43	8.25	7.49	6.99	6.62	6.13	5.81	6.17 / 8.77		
GHLC-17	12.72	12.08	9.34	8.24	7.48	6.98	6.61	6.13	5.80	6.21 / 8.55		
GHLC-18	12.70	12.06	9.35	8.21	7.46	6.97	6.60	6.13	5.80	6.21 / 8.58		
GHLC-19	12.81	12.18	9.48	8.25	7.48	6.99	6.63	6.14	5.82	6.22 / 8.60		
GHLC-20	12.90	12.29	9.52	8.32	7.49	6.98	6.61	6.13	5.80	6.29 / 8.47		
GHLC-21	12.92	12.24	9.53	8.32	7.53	7.04	6.67	6.20	5.86	6.34 / 8.76		
GHLC-22	13.01	12.36	9.54	8.30	7.50	7.00	6.63	6.15	5.83	6.38 / 8.49		
GHLC-23	13.18	12.53	9.58	8.38	7.54	7.02	6.66	6.17	5.84	6.41 / 8.59		
GHLC-24	13.15	12.48	9.59	8.40	7.54	7.02	6.66	6.16	5.84	6.45 / 8.60		
GHLC-25	13.07	12.41	9.53	8.41	7.56	7.02	6.64	6.15	5.82	6.49 / 9.74		
GHLC-26	12.57	11.88	9.25	8.21	7.41	6.93	6.60	6.14	5.82	6.38 / 8.52		
GHLC-27	12.28	11.56	9.01	8.02	7.33	6.91	6.57	6.12	5.82	6.54 / 8.59		
GHLC-28	12.70	11.98	9.23	8.19	7.40	6.94	6.60	6.13	5.81	6.47 / 8.54		
GHLC-29	12.15	11.41	8.96	8.01	7.35	6.94	6.61	6.16	5.87	6.58 / 8.80		
GHLC-30	12.12	11.31	9.02	8.06	7.41	7.00	6.67	6.23	5.93	6.57 / 9.48		
GHLC-31	11.83	11.05	8.81	7.90	7.29	6.90	6.57	6.14	5.86	6.45 / 8.87		
GHLC-32	11.51	10.75	8.60	7.78	7.19	6.81	6.50	6.08	5.79	6.38 / 8.46		
GHLC-33	11.94	11.12	8.80	7.88	7.26	6.87	6.55	6.11	5.82	6.50 / 8.52		
GHLC-34	11.52	10.71	8.61	7.73	7.18	6.81	6.50	6.09	5.80	6.35 / 8.44		
GHLC-35	11.66	10.82	8.63	7.73	7.18	6.82	6.50	6.08	5.79	6.38 / 8.48		
GHLC-36	12.20	11.39	8.94	7.96	7.31	6.93	6.59	6.15	5.85	6.52 / 8.65		
GHLC-37	12.03	11.20	8.80	7.86	7.26	6.89	6.56	6.12	5.82	6.46 / 8.55		
GHLC-38	12.55	11.74	9.05	8.05	7.33	6.92	6.58	6.12	5.82	6.59 / 8.58		
GHLC-39	12.38	11.51	8.96	8.04	7.36	6.96	6.63	6.17	5.87	6.51 / 8.90		
GHLC-40	13.05	12.20	9.29	8.21	7.46	7.02	6.68	6.19	5.88	6.69 / 8.69		
GHLC-41	12.57	11.72	9.06	8.08	7.37	6.96	6.62	6.15	5.85	6.52 / 8.95		
GHLC-42	13.16	12.29	9.37	8.26	7.52	7.07	6.73	6.24	5.93	6.68 / 9.31		
GHLC-43	13.64	12.76	9.51	8.36	7.51	7.05	6.70	6.19	5.87	6.77 / 8.73		
GHLC-44	14.46	13.62	10.05	8.61	7.69	7.16	6.81	6.25	5.91	6.84 / 8.85		

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・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-45	14.23	13.30	9.85	8.52	7.64	7.14	6.78	6.25	5.91	6.81 / 8.82		
GHLC-46	14.41	13.50	9.97	8.60	7.70	7.16	6.80	6.25	5.91	6.84 / 8.84		
GHLC-47	14.50	13.60	10.08	8.65	7.77	7.19	6.81	6.26	5.91	6.88 / 9.57		
GHLC-48	13.69	12.80	9.58	8.42	7.63	7.10	6.73	6.22	5.90	6.69 / 9.57		
GHLC-49	13.70	12.77	9.52	8.35	7.58	7.06	6.69	6.19	5.86	6.68 / 9.29		
GHLC-50	14.69	13.76	10.09	8.73	7.82	7.24	6.86	6.31	5.96	6.88 / 9.42		
GHLC-51	14.12	13.17	9.70	8.47	7.64	7.12	6.76	6.24	5.89	6.77 / 8.91		
GHLC-52	13.76	12.78	9.46	8.36	7.56	7.09	6.74	6.24	5.92	6.65 / 8.73		
GHLC-53	14.15	13.19	9.70	8.50	7.69	7.18	6.82	6.30	5.97	6.74 / 9.13		
JHF-S1	13.29	12.78	10.09	8.71	7.73	7.12	6.69	6.16	5.81	5.75 / 9.72		
JHF-S2	13.28	12.76	10.06	8.72	7.73	7.12	6.68	6.16	5.81	5.74 / 9.77		
JHF-S3	13.36	12.78	10.07	8.75	7.74	7.12	6.69	6.16	5.82	5.75 / 9.80		
JHF-S4	13.12	12.54	9.84	8.55	7.63	7.07	6.66	6.16	5.82	5.91 / 9.56		
GHLC-S1	13.57	13.03	10.48	8.93	7.75	7.00	6.53	5.95	5.57	5.51 / 9.12		
GHLC-S2	13.50	12.98	10.48	8.90	7.74	7.00	6.52	5.94	5.58	5.52 / 9.19		
GHLC-S3	13.58	13.05	10.46	8.93	7.76	7.02	6.55	5.97	5.61	5.55 / 9.28		
GHLC-S4	13.51	12.99	10.36	8.88	7.77	7.09	6.64	6.07	5.70	5.61 / 9.56		
GHLC-S5	13.51	12.99	10.33	8.86	7.79	7.10	6.65	6.08	5.72	5.60 / 9.59		
GHLC-S6	13.40	12.89	10.26	8.77	7.77	7.11	6.66	6.11	5.75	5.66 / 9.80		
GHLC-S7	13.41	12.86	10.24	8.79	7.76	7.11	6.66	6.10	5.75	5.66 / 9.83		
GHLC-S8	13.36	12.87	10.20	8.74	7.75	7.11	6.66	6.10	5.75	5.64 / 9.85		
GHLC-S9	13.39	12.82	10.17	8.76	7.73	7.09	6.65	6.09	5.74	5.66 / 9.86		
GHLC-S10	13.35	12.81	10.15	8.76	7.73	7.09	6.65	6.10	5.75	5.64 / 9.89		

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金融商品取引業者（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、金融商品取引業者（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金融商品取引業者（証券会社）からPSJ予測値の報告を受けておりますが、当該金融商品取引業者（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、個々の金融商品取引業者（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。