

P S J 予測統計値
(平均値)

2007年 12月 17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・スタルン,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・ハート・スタンズ,みずほ,UBS,メリル・ピッチ日本,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	15.52	14.44	10.92	9.76	8.94	8.45	8.08	7.51	7.17	7.83 / 10.24		
JHF-2	15.46	14.39	10.91	9.69	8.90	8.43	8.06	7.50	7.16	7.82 / 10.23		
JHF-3	15.73	14.62	11.01	9.77	8.96	8.46	8.09	7.53	7.18	7.87 / 10.25		
JHF-4	16.06	14.92	11.18	9.91	9.04	8.53	8.16	7.58	7.22	7.91 / 10.30		
JHF-5	16.42	15.31	11.31	9.94	9.05	8.49	8.12	7.51	7.14	7.98 / 10.38		
JHF-6	16.25	15.05	11.17	9.81	8.98	8.44	8.06	7.47	7.11	7.80 / 10.38		
JHF-7	15.37	14.17	10.82	9.71	8.91	8.42	8.05	7.51	7.17	7.78 / 10.28		
JHF-8	16.25	15.07	11.07	9.84	8.96	8.44	8.08	7.49	7.13	7.71 / 10.40		
GHLC-1	13.74	13.25	10.74	9.12	7.84	7.04	6.53	5.94	5.57	5.45 / 9.79		
GHLC-2	13.79	13.25	10.65	9.02	7.80	7.04	6.55	5.97	5.60	5.52 / 9.03		
GHLC-3	13.85	13.24	10.66	9.02	7.84	7.07	6.58	6.00	5.64	5.57 / 9.08		
GHLC-4	13.27	12.69	10.08	8.63	7.63	7.01	6.58	6.04	5.69	5.56 / 9.11		
GHLC-5	13.17	12.61	10.02	8.58	7.63	7.01	6.59	6.06	5.71	5.64 / 8.99		
GHLC-6	13.37	12.83	10.08	8.67	7.70	7.07	6.65	6.12	5.76	5.76 / 8.98		
GHLC-7	13.40	12.83	10.11	8.70	7.73	7.11	6.70	6.16	5.81	5.77 / 8.98		
GHLC-8	13.44	12.84	10.10	8.70	7.73	7.12	6.70	6.16	5.80	5.83 / 8.91		
GHLC-9	13.09	12.47	9.90	8.56	7.61	7.03	6.62	6.10	5.75	5.89 / 8.88		
GHLC-10	12.89	12.32	9.79	8.51	7.60	7.06	6.65	6.14	5.80	5.94 / 8.82		
GHLC-11	12.76	12.12	9.57	8.33	7.51	7.00	6.60	6.10	5.76	5.97 / 8.77		
GHLC-12	12.56	11.93	9.34	8.21	7.46	6.98	6.61	6.12	5.79	6.06 / 8.66		
GHLC-13	12.74	12.09	9.47	8.28	7.52	7.02	6.64	6.15	5.82	6.08 / 8.85		
GHLC-14	12.79	12.19	9.51	8.31	7.50	6.99	6.60	6.11	5.78	6.04 / 8.53		
GHLC-15	12.74	12.13	9.50	8.31	7.50	6.99	6.61	6.12	5.78	6.06 / 8.55		
GHLC-16	12.68	12.08	9.43	8.26	7.50	7.00	6.62	6.14	5.81	6.07 / 8.70		
GHLC-17	12.65	12.00	9.38	8.22	7.48	6.99	6.62	6.13	5.80	6.11 / 8.50		
GHLC-18	12.60	11.95	9.33	8.22	7.47	6.98	6.62	6.14	5.81	6.13 / 8.62		
GHLC-19	12.72	12.04	9.46	8.26	7.49	7.00	6.63	6.14	5.82	6.14 / 8.54		
GHLC-20	12.84	12.16	9.54	8.38	7.50	6.99	6.62	6.13	5.81	6.20 / 8.55		
GHLC-21	12.88	12.18	9.54	8.35	7.54	7.04	6.68	6.20	5.87	6.25 / 8.70		
GHLC-22	12.92	12.26	9.54	8.36	7.52	7.01	6.64	6.15	5.82	6.31 / 8.54		
GHLC-23	13.08	12.43	9.62	8.42	7.56	7.03	6.66	6.17	5.84	6.31 / 8.64		
GHLC-24	13.11	12.43	9.56	8.40	7.56	7.03	6.67	6.17	5.84	6.37 / 8.71		
GHLC-25	12.96	12.18	9.52	8.37	7.53	7.01	6.63	6.14	5.81	6.40 / 9.23		
GHLC-26	12.49	11.78	9.24	8.20	7.42	6.94	6.60	6.13	5.82	6.28 / 8.75		
GHLC-27	12.20	11.41	9.05	8.04	7.34	6.91	6.57	6.12	5.81	6.44 / 8.62		
GHLC-28	12.56	11.78	9.24	8.18	7.41	6.92	6.58	6.12	5.79	6.38 / 8.57		
GHLC-29	12.06	11.23	8.97	8.00	7.35	6.93	6.59	6.15	5.85	6.49 / 8.79		
GHLC-30	11.99	11.19	9.06	8.12	7.43	7.02	6.68	6.23	5.93	6.54 / 9.56		
GHLC-31	11.72	10.93	8.85	7.95	7.30	6.90	6.58	6.14	5.85	6.41 / 8.87		
GHLC-32	11.43	10.59	8.64	7.79	7.20	6.81	6.49	6.08	5.78	6.33 / 8.49		
GHLC-33	11.78	10.96	8.83	7.93	7.27	6.88	6.55	6.11	5.81	6.46 / 8.55		
GHLC-34	11.38	10.54	8.63	7.76	7.19	6.82	6.51	6.08	5.79	6.32 / 8.47		
GHLC-35	11.50	10.66	8.62	7.78	7.19	6.82	6.50	6.07	5.78	6.33 / 8.51		
GHLC-36	12.08	11.27	8.94	7.95	7.33	6.93	6.60	6.15	5.85	6.50 / 8.73		
GHLC-37	11.92	11.07	8.87	7.92	7.28	6.89	6.56	6.12	5.82	6.43 / 8.55		
GHLC-38	12.42	11.57	9.07	8.03	7.34	6.91	6.58	6.11	5.81	6.54 / 8.61		
GHLC-39	12.22	11.28	8.99	7.99	7.35	6.94	6.61	6.15	5.85	6.46 / 8.89		
GHLC-40	12.97	12.07	9.31	8.22	7.47	7.02	6.67	6.18	5.88	6.60 / 8.68		
GHLC-41	12.40	11.48	9.01	8.09	7.37	6.95	6.61	6.14	5.83	6.48 / 8.94		
GHLC-42	13.02	12.14	9.35	8.33	7.53	7.08	6.73	6.24	5.92	6.64 / 9.38		
GHLC-43	13.54	12.60	9.49	8.32	7.52	7.03	6.69	6.18	5.85	6.68 / 8.77		

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、日興フィナンシャルグループ

回号	Yield Curve Scenarios (%)									最低 / 最高 (%)	
	-300bp	-200bp	-100bp	-50bp	0bp	50bp	100bp	200bp	300bp		
GHLC-44	14.34	13.45	10.04	8.65	7.69	7.15	6.79	6.23	5.89	6.75 /	8.91
GHLC-45	14.13	13.13	9.82	8.58	7.65	7.13	6.79	6.24	5.90	6.73 /	8.84
GHLC-46	14.26	13.33	9.95	8.61	7.70	7.15	6.78	6.23	5.89	6.76 /	8.92
GHLC-47	14.27	13.34	10.00	8.55	7.68	7.12	6.75	6.20	5.85	6.80 /	8.99
GHLC-48	13.43	12.43	9.51	8.28	7.55	7.06	6.69	6.18	5.85	6.65 /	8.74
GHLC-49	13.45	12.40	9.42	8.22	7.49	7.01	6.64	6.13	5.80	6.63 /	8.74
GHLC-50	14.43	13.44	10.05	8.60	7.75	7.19	6.81	6.26	5.90	6.79 /	9.06
GHLC-51	13.80	12.80	9.61	8.38	7.57	7.06	6.70	6.18	5.84	6.70 /	8.81
GHLC-52	13.44	12.39	9.37	8.25	7.52	7.04	6.69	6.19	5.86	6.59 /	8.76
GHLC-53	13.87	12.78	9.65	8.41	7.64	7.13	6.76	6.24	5.91	6.67 /	9.09
JHF-S1	13.29	12.71	10.11	8.76	7.75	7.12	6.69	6.16	5.81	5.66 /	9.79
JHF-S2	13.27	12.73	10.08	8.75	7.74	7.13	6.69	6.16	5.81	5.64 /	9.82
JHF-S3	13.33	12.75	10.13	8.76	7.75	7.14	6.70	6.17	5.81	5.65 /	9.87
JHF-S4	13.08	12.46	9.85	8.56	7.64	7.07	6.67	6.16	5.82	5.82 /	9.62
GHLC-S1	13.56	12.98	10.46	8.92	7.74	7.00	6.52	5.94	5.56	5.41 /	9.00
GHLC-S2	13.49	12.93	10.44	8.90	7.73	7.00	6.52	5.94	5.57	5.42 /	9.08
GHLC-S3	13.54	12.99	10.44	8.92	7.76	7.02	6.55	5.97	5.60	5.46 /	9.20
GHLC-S4	13.54	12.97	10.38	8.89	7.78	7.09	6.63	6.06	5.70	5.51 /	9.64
GHLC-S5	13.52	12.98	10.37	8.86	7.79	7.10	6.64	6.08	5.71	5.50 /	9.64
GHLC-S6	13.43	12.85	10.24	8.83	7.77	7.11	6.66	6.10	5.74	5.55 /	9.85
GHLC-S7	13.37	12.83	10.27	8.80	7.75	7.10	6.65	6.10	5.74	5.55 /	9.86
GHLC-S8	13.40	12.83	10.27	8.77	7.76	7.10	6.66	6.10	5.74	5.55 /	9.91
GHLC-S9	13.38	12.83	10.23	8.79	7.74	7.10	6.65	6.10	5.74	5.55 /	9.92
GHLC-S10	13.35	12.77	10.18	8.76	7.74	7.08	6.65	6.09	5.73	5.55 /	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。