

P S J 予測統計値
(平均値)

2008年 2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	15.68	14.69	11.26	9.92	9.04	8.48	8.12	7.50	7.15	7.94 / 10.30		
JHF-2	15.66	14.66	11.21	9.88	9.00	8.47	8.11	7.50	7.14	7.92 / 10.29		
JHF-3	15.87	14.86	11.31	9.93	9.05	8.50	8.13	7.52	7.15	7.98 / 10.30		
JHF-4	16.20	15.18	11.50	10.03	9.14	8.56	8.19	7.57	7.20	8.01 / 10.36		
JHF-5	16.59	15.63	11.73	10.11	9.16	8.52	8.12	7.49	7.12	8.07 / 10.74		
JHF-6	16.42	15.39	11.52	9.96	9.08	8.47	8.09	7.46	7.08	7.95 / 10.60		
JHF-7	15.57	14.47	11.03	9.78	8.99	8.47	8.11	7.52	7.16	7.89 / 10.32		
JHF-8	16.45	15.37	11.41	9.94	9.04	8.49	8.13	7.51	7.14	7.85 / 10.62		
JHF-9	15.85	14.76	11.04	9.76	8.97	8.46	8.09	7.50	7.14	7.77 / 10.39		
JHF-10	15.12	13.95	10.70	9.64	8.88	8.42	8.06	7.51	7.15	7.72 / 10.30		
GHLC-1	13.88	13.34	11.13	9.35	7.97	7.09	6.53	5.92	5.53	5.41 / 9.39		
GHLC-2	13.91	13.41	11.05	9.32	7.98	7.13	6.59	5.97	5.58	5.48 / 9.34		
GHLC-3	13.96	13.41	11.03	9.27	7.96	7.14	6.63	6.01	5.63	5.55 / 9.40		
GHLC-4	13.39	12.90	10.50	8.89	7.77	7.09	6.61	6.04	5.67	5.48 / 9.28		
GHLC-5	13.34	12.80	10.42	8.86	7.75	7.07	6.62	6.05	5.69	5.56 / 9.24		
GHLC-6	13.56	13.01	10.46	8.94	7.83	7.15	6.69	6.13	5.75	5.67 / 9.30		
GHLC-7	13.62	13.09	10.52	9.00	7.88	7.20	6.75	6.18	5.80	5.69 / 9.28		
GHLC-8	13.65	13.08	10.52	8.97	7.87	7.20	6.75	6.17	5.80	5.75 / 9.27		
GHLC-9	13.27	12.69	10.25	8.81	7.75	7.12	6.68	6.12	5.76	5.80 / 9.13		
GHLC-10	13.13	12.48	10.14	8.74	7.75	7.14	6.71	6.16	5.80	5.81 / 9.02		
GHLC-11	12.90	12.33	9.96	8.56	7.64	7.08	6.66	6.12	5.77	5.84 / 8.84		
GHLC-12	12.74	12.15	9.65	8.44	7.59	7.05	6.66	6.14	5.79	5.95 / 8.84		
GHLC-13	12.93	12.33	9.83	8.52	7.66	7.11	6.70	6.18	5.83	5.99 / 9.14		
GHLC-14	12.97	12.40	9.87	8.54	7.64	7.08	6.66	6.13	5.78	5.94 / 8.78		
GHLC-15	12.95	12.33	9.83	8.49	7.62	7.07	6.65	6.13	5.78	5.95 / 8.73		
GHLC-16	12.87	12.24	9.75	8.46	7.63	7.08	6.67	6.15	5.81	5.97 / 8.86		
GHLC-17	12.81	12.24	9.69	8.45	7.61	7.07	6.66	6.15	5.80	6.00 / 8.68		
GHLC-18	12.79	12.17	9.69	8.46	7.60	7.06	6.67	6.16	5.82	6.01 / 8.77		
GHLC-19	12.89	12.30	9.79	8.51	7.62	7.08	6.68	6.17	5.83	6.02 / 8.76		
GHLC-20	13.03	12.36	9.79	8.56	7.63	7.06	6.67	6.16	5.81	6.08 / 8.72		
GHLC-21	13.02	12.39	9.80	8.59	7.67	7.11	6.72	6.21	5.86	6.15 / 8.81		
GHLC-22	13.13	12.50	9.86	8.56	7.64	7.08	6.68	6.17	5.82	6.20 / 8.69		
GHLC-23	13.24	12.61	9.93	8.64	7.68	7.10	6.70	6.18	5.83	6.21 / 8.74		
GHLC-24	13.26	12.63	9.91	8.66	7.69	7.11	6.71	6.19	5.84	6.26 / 9.02		
GHLC-25	13.10	12.43	9.83	8.57	7.67	7.07	6.66	6.13	5.79	6.29 / 9.76		
GHLC-26	12.65	12.00	9.57	8.37	7.55	7.02	6.65	6.16	5.83	6.16 / 9.16		
GHLC-27	12.38	11.62	9.25	8.26	7.45	6.96	6.62	6.13	5.82	6.32 / 8.97		
GHLC-28	12.78	12.07	9.48	8.36	7.51	7.00	6.63	6.14	5.81	6.25 / 9.02		
GHLC-29	12.20	11.47	9.27	8.24	7.46	7.00	6.66	6.17	5.86	6.35 / 8.86		
GHLC-30	12.18	11.41	9.28	8.26	7.53	7.08	6.74	6.26	5.95	6.39 / 9.68		
GHLC-31	11.94	11.13	9.09	8.14	7.39	6.96	6.63	6.17	5.86	6.35 / 9.02		
GHLC-32	11.54	10.80	8.84	7.96	7.28	6.86	6.54	6.09	5.80	6.38 / 8.62		
GHLC-33	11.98	11.18	9.04	8.04	7.35	6.92	6.59	6.12	5.82	6.40 / 8.64		
GHLC-34	11.53	10.72	8.82	7.88	7.26	6.86	6.54	6.09	5.79	6.37 / 8.55		
GHLC-35	11.67	10.86	8.86	7.91	7.26	6.87	6.54	6.08	5.78	6.40 / 8.59		
GHLC-36	12.27	11.45	9.19	8.15	7.41	6.98	6.65	6.16	5.85	6.43 / 8.76		
GHLC-37	12.09	11.29	9.06	8.05	7.36	6.94	6.61	6.14	5.82	6.44 / 8.65		
GHLC-38	12.59	11.79	9.27	8.20	7.43	6.96	6.63	6.13	5.81	6.46 / 8.69		
GHLC-39	12.41	11.59	9.26	8.20	7.45	7.00	6.66	6.18	5.86	6.47 / 8.93		
GHLC-40	13.11	12.30	9.58	8.41	7.56	7.06	6.71	6.20	5.87	6.46 / 8.74		
GHLC-41	12.57	11.72	9.29	8.22	7.48	7.00	6.66	6.16	5.84	6.48 / 8.97		

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、ペアー・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-42	13.25	12.40	9.67	8.45	7.64	7.14	6.79	6.26	5.93	6.53 / 9.43	
GHLC-43	13.69	12.87	9.84	8.56	7.65	7.10	6.75	6.20	5.86	6.57 / 8.85	
GHLC-44	14.54	13.67	10.45	8.89	7.83	7.22	6.84	6.25	5.90	6.66 / 9.41	
GHLC-45	14.28	13.41	10.20	8.78	7.79	7.20	6.82	6.25	5.89	6.61 / 9.24	
GHLC-46	14.45	13.57	10.36	8.81	7.85	7.22	6.83	6.25	5.89	6.64 / 9.47	
GHLC-47	14.42	13.58	10.36	8.76	7.81	7.17	6.76	6.18	5.82	6.68 / 9.49	
GHLC-48	13.58	12.73	9.77	8.49	7.67	7.09	6.72	6.17	5.82	6.60 / 9.00	
GHLC-49	13.66	12.74	9.73	8.46	7.64	7.07	6.70	6.16	5.81	6.61 / 9.23	
GHLC-50	14.63	13.72	10.43	8.86	7.91	7.26	6.85	6.27	5.91	6.69 / 9.54	
GHLC-51	14.03	13.11	9.96	8.55	7.70	7.11	6.74	6.18	5.83	6.64 / 9.25	
GHLC-52	13.74	12.81	9.76	8.46	7.67	7.13	6.78	6.23	5.89	6.61 / 9.08	
GHLC-53	14.15	13.18	9.99	8.62	7.77	7.20	6.84	6.27	5.92	6.67 / 9.13	
JHF-S1	13.50	12.92	10.48	9.00	7.90	7.20	6.73	6.15	5.79	5.56 / 9.84	
JHF-S2	13.45	12.93	10.46	8.98	7.90	7.19	6.73	6.16	5.80	5.56 / 9.87	
JHF-S3	13.48	12.91	10.47	9.00	7.91	7.20	6.74	6.17	5.80	5.58 / 9.92	
JHF-S4	13.24	12.66	10.20	8.83	7.78	7.15	6.72	6.18	5.83	5.71 / 9.67	
JHF-S5	12.85	12.31	9.91	8.61	7.67	7.11	6.69	6.17	5.82	5.76 / 9.57	
JHF-S6	12.84	12.27	9.90	8.54	7.58	7.02	6.61	6.11	5.77	5.76 / 8.83	
GHLC-S1	13.65	13.08	10.85	9.16	7.90	7.06	6.52	5.90	5.52	5.38 / 9.19	
GHLC-S2	13.60	13.08	10.85	9.12	7.89	7.06	6.52	5.91	5.52	5.37 / 9.15	
GHLC-S3	13.68	13.14	10.86	9.19	7.92	7.10	6.57	5.96	5.57	5.41 / 9.17	
GHLC-S4	13.65	13.10	10.75	9.15	7.93	7.16	6.67	6.06	5.68	5.45 / 9.56	
GHLC-S5	13.66	13.10	10.73	9.13	7.93	7.16	6.67	6.07	5.69	5.44 / 9.58	
GHLC-S6	13.55	13.01	10.62	9.06	7.90	7.17	6.69	6.10	5.72	5.48 / 9.85	
GHLC-S7	13.52	13.02	10.58	9.05	7.89	7.16	6.68	6.09	5.71	5.47 / 9.88	
GHLC-S8	13.52	12.96	10.58	9.04	7.89	7.16	6.68	6.10	5.72	5.48 / 9.90	
GHLC-S9	13.52	12.97	10.56	9.04	7.87	7.16	6.67	6.09	5.72	5.48 / 9.91	
GHLC-S10	13.48	12.95	10.58	9.06	7.88	7.16	6.68	6.09	5.72	5.48 / 9.94	

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（年始の最初の発表は、年末の最終営業日の午前11時現在、以下同じ。）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。
6. 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。