

P S J 予測統計値
(平均値)

2007年 12月 3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	15.65	14.68	11.02	9.77	8.98	8.47	8.08	7.53	7.19	7.91 / 10.24		
JHF-2	15.66	14.62	10.99	9.78	8.95	8.46	8.07	7.52	7.18	7.91 / 10.24		
JHF-3	15.86	14.85	11.12	9.85	9.00	8.49	8.10	7.54	7.19	7.98 / 10.26		
JHF-4	16.17	15.17	11.29	9.97	9.09	8.56	8.17	7.60	7.24	7.99 / 10.32		
JHF-5	16.59	15.61	11.46	10.00	9.09	8.52	8.12	7.52	7.16	7.93 / 10.40		
JHF-6	16.40	15.31	11.25	9.90	9.03	8.47	8.07	7.48	7.13	7.75 / 10.41		
JHF-7	15.54	14.48	10.92	9.75	8.96	8.45	8.06	7.52	7.18	7.88 / 10.32		
JHF-8	16.36	15.32	11.23	9.88	9.00	8.45	8.08	7.50	7.15	7.66 / 10.38		
GHLC-1	13.83	13.34	10.92	9.15	7.90	7.07	6.55	5.94	5.58	5.59 / 10.09		
GHLC-2	13.88	13.35	10.81	9.12	7.86	7.07	6.57	5.97	5.60	5.62 / 9.33		
GHLC-3	13.89	13.33	10.82	9.13	7.88	7.09	6.60	6.00	5.63	5.71 / 9.09		
GHLC-4	13.33	12.78	10.19	8.67	7.67	7.03	6.59	6.04	5.68	5.68 / 9.03		
GHLC-5	13.29	12.76	10.08	8.64	7.66	7.04	6.60	6.06	5.71	5.74 / 8.92		
GHLC-6	13.46	12.90	10.19	8.78	7.73	7.10	6.67	6.11	5.76	5.85 / 8.91		
GHLC-7	13.55	12.95	10.22	8.79	7.77	7.14	6.71	6.15	5.80	5.87 / 9.16		
GHLC-8	13.56	13.01	10.24	8.77	7.76	7.13	6.70	6.15	5.80	5.95 / 8.87		
GHLC-9	13.16	12.58	10.00	8.60	7.63	7.05	6.63	6.10	5.75	5.98 / 8.81		
GHLC-10	12.96	12.38	9.87	8.55	7.63	7.06	6.65	6.14	5.79	6.03 / 8.78		
GHLC-11	12.81	12.23	9.68	8.39	7.53	7.00	6.60	6.10	5.76	6.06 / 8.71		
GHLC-12	12.67	12.08	9.42	8.22	7.47	6.99	6.60	6.13	5.79	6.15 / 8.75		
GHLC-13	12.81	12.25	9.56	8.35	7.54	7.03	6.64	6.16	5.82	6.19 / 8.94		
GHLC-14	12.88	12.28	9.60	8.35	7.52	7.00	6.60	6.11	5.77	6.17 / 8.50		
GHLC-15	12.89	12.26	9.54	8.31	7.51	7.00	6.61	6.12	5.79	6.17 / 8.51		
GHLC-16	12.83	12.21	9.51	8.30	7.52	7.01	6.62	6.14	5.81	6.17 / 8.78		
GHLC-17	12.76	12.15	9.44	8.31	7.50	7.00	6.62	6.14	5.81	6.22 / 8.57		
GHLC-18	12.75	12.14	9.45	8.26	7.49	6.99	6.62	6.14	5.82	6.24 / 8.70		
GHLC-19	12.83	12.19	9.53	8.30	7.50	7.01	6.64	6.15	5.82	6.23 / 8.61		
GHLC-20	12.93	12.30	9.56	8.39	7.52	7.00	6.62	6.13	5.81	6.29 / 8.69		
GHLC-21	12.98	12.29	9.58	8.42	7.56	7.05	6.69	6.20	5.87	6.34 / 8.76		
GHLC-22	13.05	12.45	9.59	8.38	7.54	7.02	6.65	6.16	5.83	6.39 / 8.51		
GHLC-23	13.22	12.57	9.69	8.47	7.58	7.04	6.66	6.17	5.83	6.41 / 8.61		
GHLC-24	13.23	12.60	9.70	8.50	7.59	7.05	6.67	6.17	5.84	6.46 / 8.86		
GHLC-25	13.05	12.40	9.63	8.41	7.56	7.02	6.64	6.14	5.81	6.50 / 9.50		
GHLC-26	12.64	11.97	9.30	8.27	7.45	6.94	6.61	6.14	5.82	6.38 / 8.95		
GHLC-27	12.30	11.59	9.10	8.10	7.37	6.92	6.57	6.12	5.82	6.54 / 8.77		
GHLC-28	12.67	12.00	9.29	8.22	7.43	6.94	6.59	6.12	5.80	6.48 / 8.75		
GHLC-29	12.18	11.38	9.04	8.10	7.37	6.94	6.60	6.16	5.86	6.59 / 8.80		
GHLC-30	12.12	11.39	9.14	8.14	7.45	7.03	6.69	6.24	5.95	6.64 / 9.57		
GHLC-31	11.85	11.07	8.91	7.96	7.32	6.91	6.58	6.15	5.85	6.50 / 8.87		
GHLC-32	11.53	10.78	8.70	7.82	7.22	6.82	6.51	6.09	5.80	6.44 / 8.50		
GHLC-33	11.96	11.16	8.90	7.92	7.29	6.89	6.56	6.12	5.83	6.55 / 8.54		
GHLC-34	11.51	10.73	8.63	7.83	7.21	6.82	6.51	6.09	5.80	6.39 / 8.46		
GHLC-35	11.64	10.86	8.71	7.83	7.21	6.83	6.51	6.08	5.79	6.42 / 8.50		
GHLC-36	12.26	11.42	9.00	8.04	7.35	6.94	6.61	6.16	5.86	6.58 / 8.73		
GHLC-37	12.08	11.26	8.88	7.95	7.29	6.90	6.57	6.12	5.83	6.51 / 8.54		
GHLC-38	12.54	11.76	9.09	8.08	7.36	6.93	6.59	6.12	5.81	6.63 / 8.60		
GHLC-39	12.32	11.54	8.98	8.02	7.37	6.95	6.62	6.16	5.86	6.56 / 8.89		
GHLC-40	13.04	12.27	9.39	8.30	7.49	7.03	6.68	6.20	5.88	6.70 / 8.69		
GHLC-41	12.59	11.71	9.11	8.12	7.40	6.96	6.62	6.16	5.84	6.58 / 8.95		
GHLC-42	13.16	12.32	9.47	8.37	7.56	7.09	6.74	6.25	5.93	6.74 / 9.39		
GHLC-43	13.67	12.81	9.62	8.38	7.55	7.06	6.70	6.19	5.86	6.77 / 8.76		

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-44	14.46	13.62	10.13	8.71	7.72	7.17	6.80	6.24	5.90	6.84 /	8.87
GHLC-45	14.24	13.37	9.95	8.59	7.69	7.15	6.79	6.25	5.91	6.81 /	8.82
GHLC-46	14.37	13.53	10.05	8.69	7.74	7.17	6.79	6.24	5.90	6.86 /	8.97
GHLC-47	14.42	13.56	10.07	8.62	7.72	7.15	6.76	6.20	5.86	6.89 /	8.86
GHLC-48	13.56	12.70	9.59	8.37	7.59	7.08	6.70	6.19	5.86	6.75 /	8.74
GHLC-49	13.56	12.68	9.54	8.31	7.53	7.03	6.66	6.14	5.82	6.73 /	8.74
GHLC-50	14.52	13.64	10.13	8.67	7.79	7.21	6.82	6.26	5.92	6.89 /	8.99
GHLC-51	13.97	13.03	9.76	8.42	7.61	7.09	6.71	6.19	5.85	6.80 /	8.79
GHLC-52	13.58	12.65	9.49	8.28	7.56	7.06	6.70	6.20	5.87	6.70 /	8.76
GHLC-53	13.97	13.07	9.71	8.46	7.68	7.15	6.78	6.26	5.92	6.78 /	9.13
JHF-S1	13.35	12.84	10.22	8.84	7.77	7.13	6.69	6.15	5.80	5.76 /	9.72
JHF-S2	13.37	12.86	10.17	8.78	7.76	7.13	6.70	6.16	5.80	5.75 /	9.76
JHF-S3	13.38	12.86	10.23	8.83	7.78	7.14	6.70	6.16	5.81	5.76 /	9.81
JHF-S4	13.16	12.60	9.95	8.65	7.66	7.09	6.67	6.15	5.81	5.91 /	9.56
GHLC-S1	13.59	13.08	10.60	8.98	7.79	7.03	6.53	5.94	5.56	5.56 /	9.08
GHLC-S2	13.60	13.04	10.57	9.00	7.78	7.02	6.53	5.94	5.56	5.53 /	9.15
GHLC-S3	13.61	13.09	10.57	9.02	7.82	7.05	6.56	5.97	5.60	5.57 /	9.28
GHLC-S4	13.58	13.07	10.45	8.93	7.82	7.10	6.64	6.06	5.70	5.63 /	9.61
GHLC-S5	13.59	13.08	10.47	8.96	7.82	7.12	6.65	6.08	5.71	5.61 /	9.62
GHLC-S6	13.51	12.94	10.39	8.88	7.80	7.12	6.67	6.10	5.74	5.66 /	9.81
GHLC-S7	13.45	12.95	10.37	8.85	7.79	7.11	6.66	6.10	5.74	5.67 /	9.83
GHLC-S8	13.45	12.93	10.34	8.88	7.79	7.12	6.67	6.10	5.74	5.65 /	9.87
GHLC-S9	13.43	12.89	10.35	8.86	7.78	7.11	6.66	6.09	5.74	5.66 /	9.88
GHLC-S10	13.41	12.87	10.29	8.83	7.77	7.10	6.65	6.09	5.73	5.65 /	9.91

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。