

PSJ 予測統計値
(平均値)

2007年 10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,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・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	15.94	14.74	10.83	9.61	8.89	8.45	8.05	7.53	7.21	7.68 / 10.17		
JHF-2	15.97	14.68	10.78	9.64	8.87	8.43	8.05	7.52	7.19	7.69 / 10.17		
JHF-3	16.11	14.88	10.83	9.62	8.89	8.45	8.06	7.54	7.21	7.73 / 10.19		
JHF-4	16.49	15.21	10.99	9.74	8.98	8.52	8.14	7.59	7.25	7.76 / 10.26		
JHF-5	16.93	15.65	11.08	9.80	8.98	8.50	8.12	7.56	7.21	7.79 / 10.33		
JHF-6	16.66	15.39	10.91	9.70	8.92	8.45	8.07	7.52	7.19	7.59 / 10.34		
GHLC-1	13.67	13.18	10.20	8.65	7.60	6.91	6.47	5.93	5.57	5.38 / 8.81		
GHLC-2	13.70	13.15	10.17	8.63	7.60	6.94	6.49	5.95	5.59	5.48 / 8.96		
GHLC-3	13.84	13.29	10.19	8.68	7.65	6.98	6.53	5.99	5.64	5.50 / 9.00		
GHLC-4	13.22	12.65	9.65	8.29	7.45	6.91	6.52	6.02	5.68	5.68 / 9.05		
GHLC-5	13.10	12.52	9.51	8.22	7.45	6.90	6.53	6.03	5.70	5.80 / 8.97		
GHLC-6	13.26	12.69	9.59	8.28	7.50	6.95	6.57	6.07	5.75	5.94 / 8.94		
GHLC-7	13.36	12.80	9.68	8.36	7.56	7.02	6.62	6.12	5.79	5.96 / 8.98		
GHLC-8	13.38	12.76	9.63	8.33	7.53	7.00	6.61	6.11	5.77	6.02 / 8.89		
GHLC-9	13.03	12.40	9.44	8.19	7.43	6.93	6.54	6.05	5.73	6.03 / 8.83		
GHLC-10	12.84	12.27	9.40	8.15	7.44	6.95	6.58	6.10	5.77	6.11 / 8.78		
GHLC-11	12.75	12.02	9.19	8.02	7.35	6.89	6.53	6.06	5.74	6.13 / 8.68		
GHLC-12	12.56	11.86	8.98	7.95	7.33	6.88	6.55	6.10	5.78	6.25 / 8.66		
GHLC-13	12.74	12.04	9.11	8.02	7.37	6.92	6.58	6.12	5.81	6.30 / 8.85		
GHLC-14	12.73	12.07	9.11	7.99	7.35	6.88	6.54	6.08	5.76	6.22 / 8.40		
GHLC-15	12.73	12.05	9.10	7.99	7.35	6.89	6.55	6.09	5.78	6.25 / 8.42		
GHLC-16	12.68	12.00	9.10	8.00	7.35	6.91	6.57	6.11	5.80	6.27 / 8.70		
GHLC-17	12.63	11.93	9.00	7.96	7.33	6.88	6.55	6.10	5.79	6.30 / 8.39		
GHLC-18	12.59	11.91	8.98	7.94	7.32	6.88	6.56	6.11	5.80	6.27 / 8.53		
GHLC-19	12.58	11.87	8.96	7.92	7.34	6.90	6.58	6.12	5.82	6.32 / 8.55		
GHLC-20	12.90	12.15	9.20	8.05	7.36	6.91	6.58	6.11	5.81	6.37 / 8.45		
GHLC-21	12.93	12.10	9.20	8.08	7.41	6.97	6.64	6.18	5.87	6.46 / 8.71		
GHLC-22	13.00	12.26	9.26	8.09	7.39	6.94	6.61	6.14	5.83	6.50 / 8.43		
GHLC-23	13.09	12.28	9.25	8.08	7.40	6.95	6.61	6.15	5.83	6.50 / 8.52		
GHLC-24	13.16	12.39	9.26	8.16	7.42	6.96	6.63	6.16	5.85	6.56 / 8.75		
GHLC-25	13.00	12.20	9.21	8.15	7.38	6.94	6.60	6.13	5.82	6.58 / 8.85		
GHLC-26	12.54	11.70	8.94	7.93	7.29	6.88	6.57	6.13	5.83	6.47 / 8.48		
GHLC-27	12.39	11.47	8.84	7.88	7.26	6.87	6.55	6.13	5.84	6.51 / 8.84		
GHLC-28	12.72	11.85	9.02	8.00	7.33	6.89	6.57	6.12	5.82	6.52 / 9.04		
GHLC-29	12.24	11.34	8.80	7.88	7.27	6.89	6.58	6.16	5.87	6.48 / 8.69		
GHLC-30	12.22	11.29	8.83	7.89	7.35	6.98	6.66	6.24	5.96	6.43 / 9.46		
GHLC-31	11.98	11.05	8.64	7.77	7.24	6.87	6.57	6.16	5.88	6.32 / 8.86		
GHLC-32	11.67	10.70	8.49	7.68	7.15	6.78	6.50	6.10	5.82	6.25 / 8.67		
GHLC-33	12.16	11.21	8.68	7.79	7.24	6.87	6.56	6.14	5.86	6.38 / 8.81		
GHLC-34	11.68	10.71	8.46	7.65	7.16	6.80	6.52	6.12	5.84	6.25 / 8.50		
GHLC-35	11.81	10.82	8.51	7.65	7.14	6.80	6.50	6.10	5.82	6.25 / 8.41		
GHLC-36	12.37	11.36	8.73	7.83	7.27	6.92	6.60	6.17	5.89	6.39 / 8.64		
GHLC-37	12.15	11.20	8.65	7.76	7.23	6.87	6.57	6.15	5.87	6.35 / 8.54		
GHLC-38	12.58	11.61	8.80	7.85	7.27	6.91	6.59	6.15	5.86	6.46 / 8.51		
GHLC-39	12.56	11.50	8.81	7.85	7.32	6.95	6.63	6.20	5.90	6.40 / 8.89		
GHLC-40	13.10	12.10	9.09	8.02	7.39	7.00	6.67	6.22	5.92	6.57 / 8.68		
GHLC-41	12.67	11.60	8.81	7.89	7.31	6.94	6.62	6.17	5.88	6.39 / 8.86		
GHLC-42	13.38	12.32	9.17	8.13	7.48	7.07	6.74	6.28	5.97	6.55 / 9.30		
GHLC-43	13.79	12.84	9.32	8.20	7.47	7.04	6.70	6.22	5.92	6.67 / 9.03		
GHLC-44	14.67	13.67	9.75	8.44	7.63	7.15	6.81	6.28	5.96	6.82 / 9.09		
GHLC-45	14.37	13.39	9.57	8.33	7.59	7.14	6.79	6.29	5.97	6.71 / 8.95		

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・ブライザー、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-46	14.56	13.50	9.67	8.40	7.61	7.14	6.79	6.28	5.96	6.75 /	9.02
GHLC-47	14.64	13.55	9.79	8.44	7.62	7.12	6.75	6.23	5.90	6.73 /	9.40
GHLC-48	13.81	12.70	9.37	8.21	7.52	7.06	6.71	6.23	5.91	6.55 /	9.38
GHLC-49	13.87	12.72	9.38	8.21	7.48	7.04	6.68	6.20	5.88	6.56 /	9.47
GHLC-50	14.83	13.68	9.86	8.51	7.70	7.19	6.83	6.31	5.98	6.72 /	9.53
GHLC-51	14.30	13.17	9.56	8.31	7.58	7.10	6.74	6.24	5.92	6.62 /	9.68
GHLC-52	13.97	12.79	9.40	8.22	7.55	7.09	6.74	6.26	5.94	6.54 /	9.55
GHLC-53	14.27	13.10	9.44	8.29	7.59	7.14	6.80	6.31	5.98	6.61 /	9.11
JHF-S1	13.19	12.59	9.66	8.40	7.53	7.00	6.61	6.12	5.79	5.81 /	9.73
JHF-S2	13.22	12.59	9.61	8.40	7.53	7.01	6.60	6.12	5.79	5.81 /	9.76
JHF-S3	13.24	12.60	9.64	8.41	7.54	7.01	6.61	6.13	5.80	5.82 /	9.78
GHLC-S1	13.46	12.91	10.02	8.57	7.57	6.89	6.45	5.92	5.56	5.47 /	8.96
GHLC-S2	13.44	12.86	10.02	8.58	7.55	6.87	6.44	5.91	5.56	5.52 /	9.04
GHLC-S3	13.44	12.91	10.01	8.57	7.55	6.90	6.47	5.94	5.58	5.52 /	9.10
GHLC-S4	13.39	12.83	9.91	8.45	7.57	7.00	6.59	6.06	5.72	5.59 /	9.49
GHLC-S5	13.41	12.79	9.87	8.47	7.58	7.01	6.60	6.07	5.73	5.57 /	9.52
GHLC-S6	13.26	12.67	9.77	8.38	7.56	7.00	6.60	6.09	5.75	5.71 /	9.77
GHLC-S7	13.30	12.71	9.77	8.40	7.55	7.00	6.60	6.09	5.75	5.70 /	9.77
GHLC-S8	13.26	12.69	9.74	8.38	7.54	6.99	6.59	6.08	5.74	5.70 /	9.79
GHLC-S9	13.27	12.64	9.73	8.39	7.53	6.98	6.59	6.08	5.74	5.68 /	9.83
GHLC-S10	13.22	12.63	9.74	8.38	7.53	6.98	6.58	6.07	5.74	5.68 /	9.84

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。