

PSJ 予測統計値
(中央値)

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,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	13.90	13.31	10.71	9.57	8.92	8.24	7.94	7.33	7.17	7.83 / 10.23		
JHF-2	13.73	13.37	10.56	9.55	8.91	8.26	7.87	7.45	7.25	7.84 / 10.23		
JHF-3	14.08	13.65	10.58	9.63	8.96	8.27	7.79	7.37	7.20	7.90 / 10.24		
JHF-4	14.35	13.84	10.74	9.71	9.01	8.37	7.87	7.46	7.24	7.93 / 10.30		
JHF-5	14.62	14.19	10.85	9.85	9.09	8.43	7.95	7.36	7.23	7.98 / 10.38		
JHF-6	14.25	14.06	10.72	9.68	8.92	8.38	7.91	7.30	7.22	7.79 / 10.38		
JHF-7	13.76	13.37	10.53	9.62	8.99	8.29	7.80	7.39	7.21	7.80 / 10.29		
GHLC-1	13.09	12.77	10.70	9.31	8.16	7.32	6.68	6.00	5.36	5.53 / 9.52		
GHLC-2	13.16	12.83	10.64	9.33	8.15	7.32	6.64	6.00	5.36	5.62 / 9.04		
GHLC-3	13.16	12.97	10.82	9.17	7.97	7.27	6.64	6.07	5.39	5.67 / 9.09		
GHLC-4	12.96	12.52	9.85	8.78	7.79	7.11	6.57	5.96	5.46	5.66 / 9.04		
GHLC-5	13.10	12.28	9.57	8.70	7.75	7.07	6.55	5.92	5.52	5.73 / 8.93		
GHLC-6	13.29	12.55	9.79	8.76	7.85	7.12	6.57	5.95	5.58	5.84 / 8.93		
GHLC-7	13.03	12.49	10.08	8.77	7.79	7.10	6.68	5.91	5.54	5.86 / 9.12		
GHLC-8	13.07	12.47	9.96	8.73	7.86	7.11	6.64	5.94	5.59	5.94 / 8.87		
GHLC-9	12.88	12.36	9.75	8.53	7.77	7.08	6.55	5.89	5.61	5.97 / 8.82		
GHLC-10	12.69	12.27	9.90	8.46	7.74	7.01	6.61	5.88	5.62	6.02 / 8.79		
GHLC-11	12.33	12.00	9.68	8.48	7.57	6.98	6.55	5.91	5.65	6.06 / 8.70		
GHLC-12	12.01	11.89	9.37	8.38	7.46	6.99	6.47	5.91	5.67	6.15 / 8.73		
GHLC-13	12.14	12.01	9.34	8.27	7.68	6.99	6.49	5.92	5.69	6.18 / 8.92		
GHLC-14	12.25	12.20	9.71	8.48	7.55	6.94	6.53	5.95	5.67	6.15 / 8.48		
GHLC-15	12.21	12.14	9.45	8.44	7.52	6.94	6.50	5.94	5.68	6.17 / 8.51		
GHLC-16	12.13	11.98	9.37	8.47	7.53	6.98	6.49	5.94	5.68	6.17 / 8.77		
GHLC-17	12.12	11.82	9.37	8.46	7.52	6.96	6.50	5.95	5.70	6.21 / 8.55		
GHLC-18	12.05	11.62	9.31	8.53	7.55	6.99	6.49	5.95	5.69	6.21 / 8.58		
GHLC-19	12.38	11.96	9.57	8.46	7.60	6.96	6.48	5.97	5.70	6.22 / 8.60		
GHLC-20	12.17	11.92	9.58	8.50	7.58	6.96	6.43	5.97	5.74	6.29 / 8.47		
GHLC-21	12.47	11.89	9.49	8.45	7.68	7.03	6.44	6.00	5.82	6.34 / 8.76		
GHLC-22	12.54	12.08	9.54	8.42	7.59	6.88	6.49	6.01	5.80	6.38 / 8.49		
GHLC-23	12.65	12.12	9.61	8.50	7.60	6.94	6.49	6.02	5.83	6.41 / 8.59		
GHLC-24	12.55	11.95	9.51	8.45	7.56	6.90	6.47	6.04	5.88	6.45 / 8.60		
GHLC-25	12.24	11.91	9.34	8.29	7.46	6.88	6.43	6.03	5.90	6.49 / 9.74		
GHLC-26	11.76	11.28	9.22	8.13	7.41	6.88	6.34	5.96	5.81	6.38 / 8.52		
GHLC-27	11.34	11.06	8.98	8.03	7.34	6.74	6.44	6.08	5.96	6.54 / 8.59		
GHLC-28	12.09	11.66	9.19	8.07	7.33	6.87	6.39	6.02	5.89	6.47 / 8.54		
GHLC-29	11.31	10.90	8.83	7.99	7.43	6.68	6.45	6.10	5.98	6.58 / 8.80		
GHLC-30	11.43	10.52	8.68	7.91	7.39	6.65	6.49	6.15	6.02	6.57 / 9.48		
GHLC-31	10.95	10.43	8.59	7.84	7.31	6.62	6.40	6.10	5.98	6.45 / 8.87		
GHLC-32	10.74	10.27	8.50	7.72	7.14	6.59	6.36	6.09	5.97	6.38 / 8.46		
GHLC-33	11.42	10.60	8.65	7.85	7.23	6.65	6.42	6.12	5.99	6.50 / 8.52		
GHLC-34	10.78	10.38	8.48	7.65	7.14	6.63	6.38	6.12	5.99	6.35 / 8.44		
GHLC-35	10.82	10.50	8.45	7.57	7.06	6.66	6.40	6.13	6.00	6.38 / 8.48		
GHLC-36	11.72	10.77	8.74	7.96	7.32	6.78	6.48	6.15	6.03	6.52 / 8.65		
GHLC-37	11.42	10.71	8.68	7.79	7.19	6.77	6.46	6.15	6.02	6.46 / 8.55		
GHLC-38	11.90	11.21	8.85	7.85	7.24	6.80	6.50	6.17	6.03	6.59 / 8.58		
GHLC-39	11.82	10.73	8.76	7.96	7.33	6.85	6.51	6.19	6.05	6.51 / 8.90		
GHLC-40	12.25	11.22	9.12	8.17	7.44	6.98	6.55	6.18	6.04	6.69 / 8.69		
GHLC-41	11.60	10.93	8.73	7.78	7.23	6.80	6.47	6.21	6.07	6.52 / 8.95		
GHLC-42	12.27	11.35	9.06	8.12	7.47	7.04	6.62	6.25	6.10	6.68 / 9.31		
GHLC-43	12.48	11.61	9.21	8.12	7.38	6.99	6.58	6.23	6.09	6.77 / 8.73		
GHLC-44	13.14	12.84	9.59	8.48	7.59	7.01	6.67	6.28	6.12	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-45	12.77	12.33	9.46	8.37	7.51	7.02	6.67	6.29	6.13	6.81	8.82	
GHLC-46	12.91	12.55	9.48	8.43	7.55	7.09	6.70	6.30	6.14	6.84	8.84	
GHLC-47	12.88	12.63	9.49	8.44	7.56	7.08	6.73	6.31	6.16	6.88	9.57	
GHLC-48	12.38	12.00	9.27	8.17	7.42	7.00	6.67	6.28	6.13	6.69	9.57	
GHLC-49	12.34	11.75	9.12	8.16	7.42	7.01	6.60	6.27	6.12	6.68	9.29	
GHLC-50	13.08	12.64	9.51	8.42	7.58	7.10	6.79	6.34	6.18	6.88	9.42	
GHLC-51	12.60	12.28	9.30	8.21	7.49	7.04	6.70	6.31	6.16	6.77	8.91	
GHLC-52	12.64	11.97	9.26	8.10	7.40	6.99	6.64	6.30	6.14	6.65	8.73	
GHLC-53	12.83	12.28	9.33	8.17	7.46	7.04	6.71	6.30	6.16	6.74	9.13	
JHF-S1	12.69	12.06	9.97	9.01	7.82	7.01	6.57	5.93	5.56	5.75	9.72	
JHF-S2	12.66	12.05	9.85	8.99	7.78	6.99	6.57	5.93	5.57	5.74	9.77	
JHF-S3	12.66	12.06	9.90	9.00	7.78	6.99	6.58	5.96	5.57	5.75	9.80	
JHF-S4	12.51	11.97	9.80	8.70	7.55	6.86	6.57	5.96	5.66	5.91	9.56	
GHLC-S1	13.00	12.43	10.55	9.30	8.15	7.12	6.56	6.01	5.38	5.51	9.12	
GHLC-S2	12.66	12.24	10.56	9.25	8.10	7.12	6.53	6.01	5.41	5.52	9.19	
GHLC-S3	13.01	12.43	10.56	9.33	8.09	7.11	6.59	6.06	5.45	5.55	9.28	
GHLC-S4	12.69	12.24	10.34	9.20	8.17	7.22	6.57	6.03	5.44	5.61	9.56	
GHLC-S5	12.76	12.48	10.45	9.08	8.15	7.16	6.77	6.02	5.43	5.60	9.59	
GHLC-S6	12.69	12.15	10.14	8.86	8.10	7.09	6.55	5.98	5.51	5.66	9.80	
GHLC-S7	12.67	12.15	10.16	9.05	8.05	7.06	6.55	5.99	5.52	5.66	9.83	
GHLC-S8	12.64	12.10	10.07	8.87	8.01	7.04	6.54	5.98	5.51	5.64	9.85	
GHLC-S9	12.61	12.10	10.05	8.95	7.98	6.98	6.53	5.97	5.50	5.66	9.86	
GHLC-S10	12.61	12.09	10.04	9.01	7.95	7.00	6.53	5.97	5.50	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。