

PSJ 予測統計値
(平均値)

2008年 4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,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 | 15.97 | 15.21 | 11.99 | 10.30 | 9.30 | 8.62 | 8.19 | 7.56 | 7.19 | 8.07 / 12.72 | | |
| JHF-2 | 15.91 | 15.18 | 11.84 | 10.28 | 9.23 | 8.58 | 8.16 | 7.53 | 7.16 | 8.08 / 12.17 | | |
| JHF-3 | 16.14 | 15.45 | 12.05 | 10.33 | 9.31 | 8.63 | 8.19 | 7.56 | 7.18 | 8.14 / 12.60 | | |
| JHF-4 | 16.49 | 15.71 | 12.25 | 10.48 | 9.40 | 8.69 | 8.26 | 7.61 | 7.22 | 8.19 / 12.64 | | |
| JHF-5 | 17.11 | 16.26 | 12.73 | 10.71 | 9.52 | 8.75 | 8.27 | 7.58 | 7.20 | 8.24 / 14.10 | | |
| JHF-6 | 16.86 | 16.05 | 12.44 | 10.59 | 9.44 | 8.70 | 8.23 | 7.55 | 7.17 | 8.17 / 14.16 | | |
| JHF-7 | 15.85 | 15.09 | 11.69 | 10.18 | 9.23 | 8.59 | 8.16 | 7.56 | 7.20 | 8.02 / 12.72 | | |
| JHF-8 | 16.77 | 15.96 | 12.17 | 10.39 | 9.30 | 8.62 | 8.20 | 7.55 | 7.17 | 8.06 / 12.34 | | |
| JHF-9 | 16.19 | 15.45 | 11.80 | 10.20 | 9.23 | 8.58 | 8.16 | 7.55 | 7.17 | 7.89 / 12.78 | | |
| JHF-10 | 15.46 | 14.73 | 11.34 | 10.02 | 9.12 | 8.56 | 8.14 | 7.57 | 7.21 | 7.97 / 11.72 | | |
| JHF-11 | 16.38 | 15.58 | 11.77 | 10.24 | 9.28 | 8.67 | 8.25 | 7.64 | 7.27 | 8.11 / 11.86 | | |
| JHF-12 | 16.10 | 15.32 | 11.64 | 10.22 | 9.24 | 8.66 | 8.26 | 7.66 | 7.28 | 7.96 / 11.16 | | |
| GHLC-1 | 14.07 | 13.52 | 11.79 | 9.87 | 8.35 | 7.31 | 6.66 | 5.97 | 5.55 | 5.69 / 11.02 | | |
| GHLC-2 | 14.11 | 13.51 | 11.72 | 9.83 | 8.28 | 7.32 | 6.68 | 5.99 | 5.57 | 5.69 / 10.28 | | |
| GHLC-3 | 14.05 | 13.50 | 11.59 | 9.77 | 8.21 | 7.30 | 6.71 | 6.01 | 5.61 | 5.71 / 9.52 | | |
| GHLC-4 | 13.55 | 13.00 | 10.98 | 9.30 | 8.00 | 7.20 | 6.68 | 6.04 | 5.64 | 5.51 / 9.25 | | |
| GHLC-5 | 13.46 | 12.87 | 10.91 | 9.26 | 7.99 | 7.20 | 6.69 | 6.07 | 5.68 | 5.53 / 9.22 | | |
| GHLC-6 | 13.69 | 13.09 | 10.99 | 9.36 | 8.06 | 7.28 | 6.75 | 6.13 | 5.73 | 5.62 / 9.33 | | |
| GHLC-7 | 13.73 | 13.18 | 11.02 | 9.35 | 8.10 | 7.32 | 6.80 | 6.18 | 5.80 | 5.61 / 9.66 | | |
| GHLC-8 | 13.73 | 13.15 | 11.01 | 9.37 | 8.08 | 7.31 | 6.79 | 6.17 | 5.79 | 5.66 / 9.22 | | |
| GHLC-9 | 13.39 | 12.82 | 10.73 | 9.20 | 7.94 | 7.22 | 6.73 | 6.13 | 5.75 | 5.70 / 9.09 | | |
| GHLC-10 | 13.21 | 12.64 | 10.64 | 9.07 | 7.93 | 7.23 | 6.76 | 6.17 | 5.80 | 5.71 / 8.98 | | |
| GHLC-11 | 13.02 | 12.46 | 10.41 | 8.91 | 7.81 | 7.17 | 6.72 | 6.13 | 5.76 | 5.71 / 8.79 | | |
| GHLC-12 | 12.82 | 12.25 | 10.14 | 8.68 | 7.73 | 7.15 | 6.71 | 6.15 | 5.79 | 5.73 / 9.09 | | |
| GHLC-13 | 12.97 | 12.46 | 10.25 | 8.83 | 7.81 | 7.20 | 6.75 | 6.18 | 5.81 | 5.79 / 9.33 | | |
| GHLC-14 | 13.12 | 12.51 | 10.36 | 8.81 | 7.80 | 7.17 | 6.71 | 6.14 | 5.77 | 5.77 / 8.74 | | |
| GHLC-15 | 13.03 | 12.46 | 10.26 | 8.80 | 7.78 | 7.16 | 6.71 | 6.14 | 5.77 | 5.79 / 8.82 | | |
| GHLC-16 | 12.98 | 12.39 | 10.22 | 8.75 | 7.78 | 7.17 | 6.72 | 6.16 | 5.80 | 5.78 / 9.10 | | |
| GHLC-17 | 12.91 | 12.33 | 10.17 | 8.76 | 7.75 | 7.15 | 6.71 | 6.15 | 5.79 | 5.83 / 8.77 | | |
| GHLC-18 | 12.87 | 12.34 | 10.12 | 8.69 | 7.74 | 7.14 | 6.70 | 6.16 | 5.79 | 5.86 / 8.90 | | |
| GHLC-19 | 12.97 | 12.40 | 10.23 | 8.80 | 7.78 | 7.16 | 6.73 | 6.17 | 5.81 | 5.86 / 8.88 | | |
| GHLC-20 | 13.09 | 12.52 | 10.25 | 8.85 | 7.82 | 7.16 | 6.72 | 6.16 | 5.80 | 5.91 / 9.39 | | |
| GHLC-21 | 13.10 | 12.55 | 10.21 | 8.87 | 7.84 | 7.20 | 6.77 | 6.22 | 5.86 | 5.97 / 9.04 | | |
| GHLC-22 | 13.21 | 12.65 | 10.24 | 8.87 | 7.81 | 7.16 | 6.73 | 6.17 | 5.82 | 6.04 / 8.74 | | |
| GHLC-23 | 13.39 | 12.76 | 10.34 | 8.91 | 7.86 | 7.20 | 6.75 | 6.18 | 5.82 | 6.06 / 9.22 | | |
| GHLC-24 | 13.39 | 12.81 | 10.38 | 8.91 | 7.89 | 7.21 | 6.76 | 6.20 | 5.84 | 6.10 / 9.99 | | |
| GHLC-25 | 13.26 | 12.68 | 10.35 | 8.91 | 7.92 | 7.21 | 6.74 | 6.18 | 5.82 | 6.12 / 11.65 | | |
| GHLC-26 | 12.70 | 12.16 | 9.97 | 8.64 | 7.71 | 7.10 | 6.68 | 6.16 | 5.81 | 5.94 / 10.05 | | |
| GHLC-27 | 12.47 | 11.86 | 9.67 | 8.53 | 7.63 | 7.06 | 6.65 | 6.15 | 5.82 | 6.11 / 10.10 | | |
| GHLC-28 | 12.87 | 12.27 | 9.95 | 8.64 | 7.71 | 7.10 | 6.67 | 6.15 | 5.81 | 6.05 / 10.13 | | |
| GHLC-29 | 12.28 | 11.71 | 9.63 | 8.47 | 7.62 | 7.07 | 6.68 | 6.19 | 5.86 | 6.13 / 9.61 | | |
| GHLC-30 | 12.28 | 11.68 | 9.64 | 8.57 | 7.69 | 7.15 | 6.77 | 6.26 | 5.94 | 6.18 / 9.74 | | |
| GHLC-31 | 12.03 | 11.42 | 9.45 | 8.35 | 7.55 | 7.03 | 6.66 | 6.18 | 5.86 | 6.11 / 9.59 | | |
| GHLC-32 | 11.68 | 11.08 | 9.22 | 8.18 | 7.45 | 6.95 | 6.57 | 6.11 | 5.80 | 6.12 / 9.92 | | |
| GHLC-33 | 12.08 | 11.51 | 9.43 | 8.32 | 7.51 | 7.01 | 6.64 | 6.15 | 5.84 | 6.17 / 9.16 | | |
| GHLC-34 | 11.65 | 11.09 | 9.16 | 8.16 | 7.39 | 6.93 | 6.58 | 6.12 | 5.81 | 6.13 / 9.01 | | |
| GHLC-35 | 11.76 | 11.17 | 9.14 | 8.17 | 7.40 | 6.93 | 6.57 | 6.10 | 5.79 | 6.14 / 8.96 | | |
| GHLC-36 | 12.42 | 11.80 | 9.53 | 8.44 | 7.56 | 7.06 | 6.69 | 6.19 | 5.86 | 6.19 / 8.96 | | |
| GHLC-37 | 12.18 | 11.57 | 9.42 | 8.35 | 7.51 | 7.01 | 6.65 | 6.16 | 5.84 | 6.18 / 9.01 | | |
| GHLC-38 | 12.76 | 12.10 | 9.75 | 8.53 | 7.62 | 7.06 | 6.68 | 6.16 | 5.83 | 6.24 / 9.84 | | |
| GHLC-39 | 12.58 | 11.94 | 9.64 | 8.50 | 7.63 | 7.10 | 6.72 | 6.21 | 5.89 | 6.24 / 9.60 | | |

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・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 | | |
| GHLC-40 | 13.29 | 12.64 | 10.08 | 8.75 | 7.77 | 7.18 | 6.78 | 6.23 | 5.89 | 6.30 / | 9.83 |
| GHLC-41 | 12.76 | 12.12 | 9.74 | 8.53 | 7.67 | 7.11 | 6.71 | 6.19 | 5.86 | 6.25 / | 10.55 |
| GHLC-42 | 13.39 | 12.71 | 10.14 | 8.81 | 7.86 | 7.26 | 6.85 | 6.28 | 5.95 | 6.33 / | 10.49 |
| GHLC-43 | 13.97 | 13.25 | 10.40 | 8.93 | 7.89 | 7.24 | 6.82 | 6.23 | 5.88 | 6.42 / | 10.62 |
| GHLC-44 | 14.75 | 13.98 | 11.12 | 9.27 | 8.10 | 7.38 | 6.92 | 6.30 | 5.93 | 6.60 / | 10.25 |
| GHLC-45 | 14.56 | 13.76 | 10.90 | 9.19 | 8.06 | 7.36 | 6.91 | 6.31 | 5.94 | 6.51 / | 10.85 |
| GHLC-46 | 14.69 | 13.95 | 11.03 | 9.28 | 8.13 | 7.38 | 6.92 | 6.31 | 5.94 | 6.55 / | 11.67 |
| GHLC-47 | 14.89 | 14.13 | 11.17 | 9.36 | 8.19 | 7.43 | 6.93 | 6.30 | 5.92 | 6.55 / | 12.93 |
| GHLC-48 | 14.02 | 13.29 | 10.52 | 9.02 | 8.02 | 7.34 | 6.87 | 6.29 | 5.92 | 6.41 / | 12.93 |
| GHLC-49 | 14.04 | 13.34 | 10.46 | 8.91 | 7.96 | 7.28 | 6.82 | 6.25 | 5.89 | 6.41 / | 12.74 |
| GHLC-50 | 15.03 | 14.26 | 11.20 | 9.43 | 8.26 | 7.51 | 7.00 | 6.37 | 5.99 | 6.56 / | 12.97 |
| GHLC-51 | 14.45 | 13.74 | 10.74 | 9.03 | 8.05 | 7.33 | 6.88 | 6.29 | 5.92 | 6.48 / | 12.55 |
| GHLC-52 | 14.09 | 13.33 | 10.36 | 8.87 | 7.94 | 7.28 | 6.87 | 6.30 | 5.95 | 6.45 / | 11.73 |
| GHLC-53 | 14.52 | 13.73 | 10.70 | 9.06 | 8.07 | 7.37 | 6.94 | 6.35 | 5.99 | 6.48 / | 12.31 |
| JHF-S1 | 13.55 | 12.98 | 10.94 | 9.39 | 8.11 | 7.30 | 6.76 | 6.13 | 5.74 | 5.51 / | 9.87 |
| JHF-S2 | 13.59 | 12.97 | 10.97 | 9.36 | 8.12 | 7.31 | 6.78 | 6.16 | 5.77 | 5.52 / | 9.90 |
| JHF-S3 | 13.60 | 12.99 | 10.95 | 9.39 | 8.13 | 7.32 | 6.79 | 6.17 | 5.78 | 5.53 / | 9.93 |
| JHF-S4 | 13.38 | 12.79 | 10.67 | 9.14 | 7.96 | 7.25 | 6.77 | 6.20 | 5.82 | 5.60 / | 9.57 |
| JHF-S5 | 12.97 | 12.40 | 10.34 | 8.89 | 7.82 | 7.18 | 6.74 | 6.18 | 5.81 | 5.60 / | 9.43 |
| JHF-S6 | 13.00 | 12.44 | 10.37 | 8.89 | 7.83 | 7.19 | 6.74 | 6.19 | 5.82 | 5.60 / | 9.48 |
| JHF-S7 | 13.04 | 12.44 | 10.37 | 8.96 | 7.85 | 7.21 | 6.76 | 6.19 | 5.83 | 5.60 / | 9.44 |
| GHLC-S1 | 13.92 | 13.29 | 11.48 | 9.71 | 8.29 | 7.32 | 6.68 | 5.98 | 5.57 | 5.56 / | 10.99 |
| GHLC-S2 | 13.88 | 13.30 | 11.50 | 9.68 | 8.26 | 7.30 | 6.67 | 5.98 | 5.57 | 5.54 / | 10.99 |
| GHLC-S3 | 13.92 | 13.28 | 11.51 | 9.71 | 8.23 | 7.31 | 6.68 | 6.00 | 5.59 | 5.58 / | 10.28 |
| GHLC-S4 | 13.80 | 13.22 | 11.29 | 9.63 | 8.17 | 7.31 | 6.74 | 6.06 | 5.66 | 5.53 / | 9.34 |
| GHLC-S5 | 13.79 | 13.23 | 11.26 | 9.57 | 8.18 | 7.31 | 6.75 | 6.07 | 5.68 | 5.51 / | 9.36 |
| GHLC-S6 | 13.69 | 13.12 | 11.11 | 9.52 | 8.13 | 7.30 | 6.76 | 6.10 | 5.70 | 5.50 / | 9.72 |
| GHLC-S7 | 13.62 | 13.10 | 11.12 | 9.49 | 8.13 | 7.30 | 6.75 | 6.10 | 5.70 | 5.50 / | 9.73 |
| GHLC-S8 | 13.62 | 13.06 | 11.10 | 9.49 | 8.12 | 7.29 | 6.75 | 6.10 | 5.70 | 5.51 / | 9.78 |
| GHLC-S9 | 13.63 | 13.08 | 11.07 | 9.45 | 8.10 | 7.28 | 6.74 | 6.09 | 5.69 | 5.50 / | 9.79 |
| GHLC-S10 | 13.59 | 13.01 | 11.07 | 9.42 | 8.10 | 7.28 | 6.74 | 6.09 | 5.69 | 5.49 / | 9.83 |

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。