

P S J 予測統計値
(中央値)

2008年 6月 16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・スタール,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,みずほ,UBS,メリル・リンチ日本,大和SMBC,新生,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		
JHF-1	13.17	12.29	9.73	8.93	8.26	7.84	7.64	7.51	7.48	7.48 /	9.88
JHF-2	13.11	12.22	9.73	8.97	8.27	7.78	7.62	7.51	7.48	7.47 /	9.88
JHF-3	13.35	12.37	9.77	9.02	8.32	7.77	7.52	7.46	7.46	7.51 /	9.88
JHF-4	13.65	12.43	9.82	9.06	8.40	7.83	7.59	7.50	7.50	7.53 /	9.91
JHF-5	14.04	12.60	9.90	9.10	8.52	7.89	7.55	7.39	7.38	7.54 /	9.98
JHF-6	13.88	12.44	9.76	8.94	8.43	7.87	7.51	7.33	7.24	7.40 /	9.98
JHF-7	12.88	11.89	9.66	8.94	8.25	7.78	7.56	7.50	7.50	7.54 /	9.90
JHF-8	13.73	12.55	9.55	8.78	8.34	7.88	7.51	7.31	7.11	7.34 /	10.00
JHF-9	13.21	11.76	9.43	8.78	8.37	7.82	7.50	7.36	7.20	7.35 /	9.95
JHF-10	12.75	11.63	9.53	8.92	8.20	7.72	7.56	7.52	7.52	7.56 /	9.90
JHF-11	13.35	11.89	9.75	9.07	8.41	7.82	7.61	7.54	7.54	7.61 /	9.96
JHF-12	13.17	11.88	9.73	8.92	8.39	7.84	7.66	7.59	7.58	7.63 /	9.98
JHF-13	13.44	12.33	9.74	9.04	8.36	7.96	7.85	7.73	7.71	7.64 /	10.33
JHF-14	13.21	12.09	9.67	8.89	8.20	7.84	7.66	7.63	7.62	7.63 /	9.98
GHLC-1	12.58	12.23	8.82	8.12	7.26	6.73	6.38	5.70	5.27	4.92 /	8.55
GHLC-2	12.65	12.00	8.82	8.18	7.27	6.77	6.32	5.77	5.31	4.97 /	9.09
GHLC-3	12.72	12.42	8.98	8.23	7.30	6.81	6.30	5.79	5.32	5.02 /	9.31
GHLC-4	12.62	11.72	8.67	8.01	7.15	6.80	6.35	5.73	5.33	5.01 /	9.28
GHLC-5	12.35	11.47	8.86	8.03	7.16	6.83	6.39	5.74	5.35	5.08 /	9.01
GHLC-6	12.29	11.65	8.92	8.22	7.37	6.87	6.47	5.79	5.38	5.17 /	9.01
GHLC-7	12.51	11.84	8.82	8.20	7.40	6.92	6.49	5.76	5.36	5.18 /	8.88
GHLC-8	12.60	11.87	8.88	8.27	7.45	6.91	6.52	5.79	5.40	5.25 /	8.90
GHLC-9	12.26	11.63	8.87	8.08	7.34	6.85	6.50	5.80	5.42	5.29 /	8.83
GHLC-10	12.41	11.59	8.80	8.15	7.36	6.84	6.51	5.77	5.43	5.28 /	8.72
GHLC-11	12.10	11.28	8.77	7.95	7.27	6.82	6.49	5.76	5.47	5.32 /	8.65
GHLC-12	11.92	10.88	8.66	7.80	7.27	6.82	6.41	5.71	5.50	5.36 /	8.52
GHLC-13	12.15	10.81	8.84	8.01	7.33	6.82	6.44	5.73	5.51	5.39 /	8.73
GHLC-14	12.26	10.96	8.72	8.00	7.29	6.86	6.49	5.74	5.53	5.37 /	8.32
GHLC-15	12.24	11.24	8.71	7.95	7.26	6.87	6.47	5.72	5.52	5.37 /	8.32
GHLC-16	12.13	11.03	8.74	7.96	7.26	6.83	6.43	5.72	5.53	5.37 /	8.54
GHLC-17	12.08	10.90	8.72	7.93	7.25	6.85	6.46	5.74	5.54	5.43 /	8.30
GHLC-18	11.91	10.87	8.79	7.90	7.29	6.81	6.44	5.73	5.54	5.43 /	8.45
GHLC-19	11.93	10.93	8.81	7.95	7.30	6.82	6.43	5.74	5.54	5.45 /	8.34
GHLC-20	11.82	10.81	8.71	7.99	7.27	6.82	6.41	5.76	5.57	5.49 /	8.19
GHLC-21	11.81	10.71	8.81	7.97	7.35	6.84	6.39	5.77	5.59	5.52 /	8.46
GHLC-22	12.06	10.52	8.76	8.04	7.30	6.81	6.42	5.78	5.58	5.58 /	8.19
GHLC-23	12.09	10.86	8.78	8.05	7.32	6.81	6.43	5.80	5.59	5.58 /	8.26
GHLC-24	12.08	10.45	8.80	8.00	7.29	6.79	6.41	5.81	5.62	5.62 /	8.29
GHLC-25	11.95	10.70	8.79	7.89	7.22	6.73	6.38	5.81	5.64	5.63 /	8.73
GHLC-26	11.29	10.18	8.58	7.74	7.19	6.68	6.27	5.76	5.58	5.54 /	8.25
GHLC-27	10.75	10.15	8.32	7.61	7.12	6.60	6.27	5.79	5.68	5.65 /	8.25
GHLC-28	11.50	10.27	8.54	7.68	7.13	6.74	6.31	5.78	5.64	5.60 /	8.19
GHLC-29	10.65	9.99	8.35	7.62	7.15	6.59	6.26	5.82	5.72	5.69 /	8.55
GHLC-30	10.27	9.70	8.30	7.58	7.08	6.58	6.25	5.88	5.76	5.73 /	9.33
GHLC-31	10.28	9.80	8.17	7.50	7.06	6.51	6.20	5.83	5.72	5.67 /	8.63
GHLC-32	10.19	9.66	8.02	7.35	7.02	6.49	6.15	5.83	5.76	5.70 /	8.13
GHLC-33	10.68	9.78	8.16	7.54	7.06	6.55	6.23	5.84	5.76	5.71 /	8.23
GHLC-34	10.31	9.71	8.03	7.40	6.99	6.48	6.15	5.84	5.77	5.71 /	8.19
GHLC-35	10.49	9.77	8.08	7.43	6.89	6.53	6.16	5.86	5.79	5.71 /	8.18
GHLC-36	10.87	10.03	8.25	7.58	7.12	6.59	6.25	5.89	5.78	5.73 /	8.47
GHLC-37	10.77	9.95	8.18	7.50	7.02	6.55	6.22	5.88	5.77	5.73 /	8.29

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、みずほ、UBS、メリル・ピッチ日本、大和SMBC、新生、日興シティグループ

回号	Yield Curve Scenarios (%)									最低 / 最高(%)
	-300bp	-200bp	-100bp	-50bp	0bp	50bp	100bp	200bp	300bp	
GHLC-38	11.08	10.19	8.33	7.59	7.09	6.61	6.29	5.88	5.79	5.76 / 8.29
GHLC-39	10.99	10.05	8.24	7.57	7.13	6.61	6.26	5.91	5.79	5.77 / 8.64
GHLC-40	11.18	10.16	8.49	7.74	7.19	6.69	6.35	5.91	5.79	5.76 / 8.41
GHLC-41	10.76	10.12	8.27	7.60	7.04	6.53	6.27	5.92	5.81	5.78 / 8.67
GHLC-42	11.27	10.40	8.47	7.71	7.23	6.73	6.34	5.97	5.85	5.82 / 9.12
GHLC-43	11.87	10.45	8.59	7.81	7.30	6.70	6.41	5.95	5.82	5.85 / 8.44
GHLC-44	12.84	11.44	8.86	8.03	7.45	6.89	6.52	5.99	5.85	5.91 / 8.56
GHLC-45	12.35	11.06	8.75	7.92	7.35	6.82	6.47	6.00	5.86	5.87 / 8.51
GHLC-46	12.50	10.90	8.77	7.94	7.38	6.83	6.49	6.00	5.87	5.90 / 8.76
GHLC-47	12.60	11.41	8.80	7.92	7.33	6.92	6.47	6.03	5.90	5.94 / 9.20
GHLC-48	11.64	10.46	8.47	7.74	7.24	6.79	6.39	6.01	5.88	5.86 / 9.20
GHLC-49	11.52	10.39	8.46	7.68	7.20	6.70	6.37	5.99	5.87	5.86 / 9.20
GHLC-50	12.64	11.13	8.74	7.90	7.31	6.90	6.49	6.06	5.92	5.92 / 9.23
GHLC-51	11.95	10.55	8.52	7.78	7.24	6.78	6.41	6.03	5.90	5.89 / 9.09
GHLC-52	11.64	10.56	8.39	7.69	7.19	6.84	6.38	6.03	5.90	5.90 / 8.78
GHLC-53	11.91	10.73	8.48	7.76	7.24	6.88	6.45	6.08	5.93	5.92 / 8.99
JHF-S1	11.93	11.16	9.38	8.26	7.28	6.81	6.46	5.93	5.51	5.07 / 9.89
JHF-S2	11.92	11.16	9.11	8.22	7.29	6.75	6.47	5.94	5.53	5.07 / 9.93
JHF-S3	11.95	11.22	9.24	8.27	7.24	6.74	6.47	5.95	5.54	5.08 / 9.97
JHF-S4	11.95	11.19	8.90	8.11	7.17	6.79	6.60	5.90	5.58	5.19 / 9.58
JHF-S5	11.87	11.00	8.80	7.93	7.09	6.79	6.58	5.87	5.59	5.23 / 9.45
JHF-S6	11.87	11.10	8.81	7.90	7.07	6.78	6.57	5.84	5.59	5.24 / 9.45
JHF-S7	11.94	11.10	8.81	7.91	7.08	6.79	6.58	5.85	5.59	5.23 / 9.47
JHF-S8	10.91	10.16	8.22	7.45	7.07	6.79	6.45	5.82	5.61	5.35 / 8.68
GHLC-S1	12.51	11.52	8.98	8.19	7.09	6.71	6.31	5.74	5.22	4.87 / 8.75
GHLC-S2	12.17	11.65	8.99	8.15	7.07	6.71	6.31	5.73	5.21	4.85 / 8.82
GHLC-S3	12.39	11.49	9.00	8.15	7.09	6.69	6.31	5.70	5.27	4.90 / 8.92
GHLC-S4	12.20	11.70	9.02	8.28	7.18	6.74	6.34	5.72	5.34	4.95 / 9.60
GHLC-S5	12.37	11.59	9.12	8.22	7.16	6.74	6.44	5.71	5.34	4.94 / 9.60
GHLC-S6	12.13	11.19	8.98	8.32	7.26	6.75	6.34	5.68	5.47	4.98 / 9.89
GHLC-S7	12.02	11.20	8.98	8.28	7.24	6.72	6.30	5.63	5.48	5.01 / 9.89
GHLC-S8	12.19	11.19	8.99	8.22	7.24	6.71	6.30	5.63	5.47	4.98 / 9.93
GHLC-S9	12.28	11.24	8.97	8.24	7.20	6.71	6.28	5.63	5.47	4.98 / 9.95
GHLC-S10	11.96	11.15	8.97	8.25	7.22	6.62	6.19	5.64	5.48	4.99 / 9.99

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。