

PSJ 予測統計値
(平均値)

2008年 7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,メルガン・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・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	14.46	13.60	10.23	9.22	8.63	8.21	7.91	7.49	7.18	7.55 / 10.04	
JHF-2	14.40	13.52	10.13	9.16	8.60	8.16	7.88	7.46	7.16	7.57 / 10.05	
JHF-3	14.57	13.72	10.24	9.21	8.57	8.17	7.88	7.47	7.17	7.59 / 10.05	
JHF-4	14.85	13.95	10.34	9.32	8.64	8.23	7.92	7.51	7.21	7.62 / 10.08	
JHF-5	15.31	14.41	10.51	9.36	8.67	8.21	7.90	7.48	7.16	7.66 / 10.16	
JHF-6	15.12	14.21	10.34	9.27	8.62	8.17	7.88	7.46	7.15	7.56 / 10.14	
JHF-7	14.24	13.31	9.97	9.09	8.56	8.17	7.89	7.49	7.18	7.59 / 10.04	
JHF-8	15.02	14.04	10.28	9.23	8.59	8.16	7.87	7.45	7.14	7.48 / 10.17	
JHF-9	14.48	13.53	9.99	9.09	8.51	8.14	7.86	7.45	7.14	7.43 / 10.09	
JHF-10	13.87	12.87	9.78	8.99	8.48	8.15	7.89	7.49	7.19	7.56 / 10.03	
JHF-11	14.69	13.71	10.14	9.18	8.60	8.23	7.96	7.55	7.26	7.54 / 10.12	
JHF-12	14.56	13.60	10.13	9.15	8.62	8.26	8.00	7.59	7.29	7.43 / 10.11	
JHF-13	14.51	13.47	10.12	9.22	8.67	8.33	8.06	7.66	7.36	7.39 / 10.42	
JHF-14	14.09	13.04	9.92	9.11	8.59	8.26	8.01	7.61	7.30	7.47 / 10.10	
JHF-15	15.95	14.91	10.65	9.46	8.83	8.42	8.13	7.70	7.38	7.43 / 10.35	
GHLC-1	13.08	12.57	9.88	8.36	7.35	6.67	6.22	5.72	5.40	5.15 / 8.72	
GHLC-2	13.20	12.65	9.88	8.38	7.37	6.69	6.26	5.77	5.44	5.22 / 8.70	
GHLC-3	13.36	12.77	9.95	8.47	7.43	6.74	6.30	5.81	5.50	5.21 / 8.96	
GHLC-4	12.83	12.31	9.54	8.27	7.34	6.76	6.35	5.87	5.56	5.14 / 9.19	
GHLC-5	12.83	12.26	9.47	8.23	7.42	6.81	6.44	5.96	5.64	5.21 / 9.02	
GHLC-6	13.04	12.47	9.61	8.34	7.49	6.90	6.51	6.03	5.72	5.30 / 8.97	
GHLC-7	13.09	12.54	9.64	8.42	7.53	6.95	6.56	6.10	5.80	5.33 / 9.11	
GHLC-8	13.17	12.57	9.67	8.42	7.56	6.96	6.58	6.11	5.80	5.40 / 8.91	
GHLC-9	12.87	12.29	9.47	8.29	7.47	6.89	6.52	6.07	5.76	5.40 / 8.83	
GHLC-10	12.78	12.21	9.40	8.26	7.50	6.97	6.59	6.13	5.82	5.41 / 8.89	
GHLC-11	12.62	12.08	9.21	8.17	7.42	6.89	6.55	6.10	5.80	5.41 / 8.64	
GHLC-12	12.47	11.93	9.09	8.10	7.41	6.90	6.58	6.14	5.85	5.45 / 8.74	
GHLC-13	12.68	12.14	9.28	8.21	7.48	6.95	6.62	6.18	5.88	5.49 / 9.04	
GHLC-14	12.73	12.15	9.28	8.17	7.43	6.91	6.57	6.13	5.82	5.47 / 8.50	
GHLC-15	12.75	12.16	9.22	8.16	7.42	6.91	6.58	6.13	5.83	5.45 / 8.50	
GHLC-16	12.69	12.07	9.21	8.17	7.43	6.93	6.59	6.16	5.85	5.47 / 8.74	
GHLC-17	12.63	12.10	9.17	8.13	7.43	6.92	6.60	6.16	5.86	5.50 / 8.64	
GHLC-18	12.64	11.99	9.15	8.15	7.40	6.92	6.59	6.17	5.87	5.53 / 8.64	
GHLC-19	12.58	11.98	9.16	8.11	7.39	6.91	6.60	6.17	5.88	5.53 / 8.62	
GHLC-20	12.48	11.91	9.08	8.06	7.34	6.88	6.58	6.15	5.86	5.58 / 8.42	
GHLC-21	12.51	11.90	9.12	8.14	7.39	6.94	6.63	6.21	5.92	5.63 / 8.63	
GHLC-22	12.63	12.04	9.16	8.10	7.36	6.90	6.59	6.17	5.88	5.67 / 8.41	
GHLC-23	12.73	12.15	9.18	8.11	7.41	6.92	6.61	6.19	5.89	5.70 / 8.64	
GHLC-24	12.69	12.09	9.13	8.09	7.40	6.92	6.62	6.19	5.90	5.72 / 8.55	
GHLC-25	12.49	11.84	9.01	8.01	7.34	6.89	6.59	6.18	5.89	5.72 / 8.64	
GHLC-26	12.04	11.45	8.80	7.92	7.29	6.85	6.56	6.16	5.88	5.61 / 8.93	
GHLC-27	11.73	11.02	8.58	7.74	7.22	6.82	6.55	6.17	5.89	5.73 / 8.91	
GHLC-28	12.12	11.45	8.78	7.83	7.27	6.83	6.56	6.16	5.87	5.69 / 8.96	
GHLC-29	11.61	10.92	8.60	7.76	7.26	6.86	6.61	6.23	5.95	5.76 / 8.83	
GHLC-30	11.55	10.84	8.68	7.85	7.35	6.95	6.70	6.31	6.04	5.80 / 9.49	
GHLC-31	11.32	10.62	8.47	7.70	7.23	6.87	6.60	6.23	5.95	5.74 / 9.17	
GHLC-32	10.94	10.22	8.25	7.58	7.13	6.81	6.53	6.16	5.89	5.74 / 9.20	
GHLC-33	11.39	10.69	8.47	7.71	7.20	6.86	6.57	6.19	5.91	5.78 / 9.20	
GHLC-34	11.01	10.24	8.25	7.55	7.13	6.81	6.54	6.17	5.89	5.75 / 9.22	
GHLC-35	11.12	10.38	8.31	7.55	7.13	6.81	6.53	6.15	5.88	5.77 / 9.23	
GHLC-36	11.72	10.94	8.58	7.76	7.27	6.89	6.61	6.22	5.94	5.80 / 9.24	

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、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-37	11.48	10.76	8.47	7.72	7.22	6.84	6.58	6.19	5.92	5.80 / 9.25
GHLC-38	11.94	11.20	8.64	7.75	7.25	6.86	6.58	6.18	5.90	5.82 / 9.27
GHLC-39	11.71	10.94	8.54	7.77	7.25	6.87	6.60	6.21	5.93	5.83 / 8.77
GHLC-40	12.35	11.66	8.83	7.93	7.33	6.92	6.62	6.22	5.93	5.85 / 8.62
GHLC-41	11.85	11.03	8.59	7.73	7.24	6.84	6.58	6.19	5.91	5.84 / 8.82
GHLC-42	12.39	11.65	8.86	7.99	7.37	6.95	6.68	6.28	5.99	5.89 / 9.27
GHLC-43	12.91	12.12	9.03	8.00	7.35	6.91	6.62	6.21	5.92	5.95 / 8.63
GHLC-44	13.70	12.85	9.42	8.23	7.50	7.01	6.68	6.25	5.96	6.03 / 8.75
GHLC-45	13.41	12.58	9.24	8.13	7.45	6.99	6.68	6.26	5.96	5.99 / 8.71
GHLC-46	13.51	12.69	9.31	8.16	7.46	6.99	6.68	6.25	5.96	6.02 / 8.70
GHLC-47	13.59	12.79	9.28	8.20	7.45	6.98	6.67	6.24	5.94	6.04 / 8.74
GHLC-48	12.75	11.97	8.89	7.94	7.34	6.92	6.64	6.24	5.95	5.95 / 8.61
GHLC-49	12.79	11.98	8.84	7.88	7.29	6.89	6.60	6.20	5.91	5.95 / 8.63
GHLC-50	13.68	12.85	9.34	8.21	7.51	7.04	6.73	6.30	6.00	6.03 / 8.80
GHLC-51	13.15	12.30	8.99	8.00	7.35	6.93	6.64	6.22	5.93	5.99 / 8.65
GHLC-52	12.83	11.99	8.87	7.97	7.33	6.94	6.65	6.26	5.97	5.96 / 8.62
GHLC-53	13.17	12.36	9.04	8.05	7.40	7.00	6.71	6.31	6.01	6.01 / 8.97
JHF-S1	12.90	12.33	9.55	8.37	7.48	6.90	6.50	6.03	5.72	5.21 / 9.85
JHF-S2	12.90	12.34	9.59	8.36	7.47	6.89	6.50	6.03	5.72	5.20 / 9.89
JHF-S3	12.95	12.38	9.60	8.34	7.47	6.89	6.50	6.03	5.74	5.21 / 9.94
JHF-S4	12.96	12.34	9.36	8.19	7.41	6.89	6.55	6.12	5.82	5.30 / 9.61
JHF-S5	12.58	11.96	9.24	8.23	7.50	6.98	6.63	6.18	5.89	5.31 / 9.90
JHF-S6	12.59	12.03	9.31	8.19	7.51	6.97	6.63	6.19	5.89	5.34 / 9.91
JHF-S7	12.60	12.02	9.29	8.22	7.52	6.98	6.65	6.21	5.91	5.33 / 9.93
JHF-S8	11.73	11.13	8.75	7.88	7.28	6.83	6.53	6.12	5.84	5.41 / 9.95
JHF-S9	11.75	11.12	8.75	7.87	7.28	6.86	6.53	6.12	5.83	5.41 / 9.96
GHLC-S1	13.02	12.45	9.80	8.43	7.50	6.81	6.34	5.81	5.48	5.09 / 9.98
GHLC-S2	12.98	12.45	9.77	8.42	7.48	6.77	6.33	5.82	5.48	5.06 / 10.00
GHLC-S3	13.04	12.46	9.80	8.46	7.51	6.79	6.35	5.84	5.51	5.10 / 10.02
GHLC-S4	13.05	12.48	9.82	8.51	7.59	6.88	6.44	5.93	5.60	5.13 / 10.04
GHLC-S5	13.06	12.52	9.84	8.50	7.58	6.88	6.44	5.95	5.62	5.12 / 9.82
GHLC-S6	12.96	12.45	9.75	8.47	7.58	6.92	6.49	5.98	5.67	5.14 / 9.88
GHLC-S7	12.99	12.39	9.72	8.44	7.56	6.91	6.48	5.98	5.66	5.15 / 9.80
GHLC-S8	13.76	13.20	10.09	8.59	7.57	6.91	6.48	5.98	5.67	5.16 / 9.84
GHLC-S9	13.59	13.04	10.01	8.52	7.53	6.89	6.47	5.97	5.66	5.14 / 9.84
GHLC-S10	13.69	13.17	10.08	8.59	7.55	6.89	6.47	5.97	5.66	5.14 / 9.88

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。