

PSJ 予測統計値
(中央値)

2008年 8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、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	13.39	12.89	10.53	9.69	8.90	8.12	7.80	7.50	7.45	7.64 /	10.16
JHF-2	13.39	12.92	10.41	9.55	8.90	8.13	7.73	7.50	7.47	7.63 /	10.15
JHF-3	13.38	13.11	10.50	9.58	8.95	8.15	7.69	7.44	7.44	7.69 /	10.15
JHF-4	13.72	13.21	10.62	9.75	9.02	8.23	7.74	7.49	7.46	7.70 /	10.19
JHF-5	13.99	13.49	10.70	9.51	8.83	8.24	7.75	7.37	7.34	7.75 /	10.26
JHF-6	13.85	13.26	10.52	9.40	8.67	8.25	7.71	7.36	7.19	7.71 /	10.26
JHF-7	13.15	12.57	10.11	9.42	8.87	8.13	7.69	7.47	7.46	7.60 /	10.13
JHF-8	13.78	13.43	10.35	9.33	8.52	8.14	7.72	7.38	7.16	7.72 /	10.25
JHF-9	13.11	12.87	9.89	9.10	8.54	8.19	7.69	7.39	7.17	7.61 /	10.16
JHF-10	12.73	12.15	9.96	9.28	8.78	8.06	7.67	7.48	7.48	7.55 /	10.09
JHF-11	13.40	12.84	10.21	9.54	8.93	8.20	7.74	7.50	7.48	7.68 /	10.17
JHF-12	13.34	12.77	10.24	9.61	8.91	8.19	7.76	7.54	7.53	7.66 /	10.17
JHF-13	13.26	12.58	10.39	9.45	8.89	8.23	7.95	7.72	7.67	7.66 /	10.29
JHF-14	12.94	12.31	10.21	9.51	8.78	8.18	7.79	7.60	7.59	7.60 /	10.12
JHF-15	14.42	13.77	10.78	9.92	9.20	8.45	8.02	7.68	7.61	7.86 /	10.35
JHF-16	15.01	14.50	11.13	10.08	9.26	8.46	8.16	7.74	7.65	7.98 /	10.59
GHLC-1	12.94	12.68	9.97	8.62	8.15	7.24	6.62	5.92	5.38	5.55 /	8.89
GHLC-2	12.91	12.60	9.94	8.75	8.16	7.26	6.62	5.98	5.41	5.52 /	8.85
GHLC-3	12.93	12.67	10.18	8.94	8.09	7.29	6.63	6.06	5.41	5.57 /	8.86
GHLC-4	12.68	12.31	9.57	8.63	7.95	7.11	6.66	5.99	5.42	5.42 /	9.13
GHLC-5	12.89	12.38	9.38	8.75	7.82	7.07	6.67	6.04	5.42	5.46 /	9.08
GHLC-6	12.89	12.41	9.77	8.84	7.99	7.14	6.67	6.08	5.46	5.51 /	9.00
GHLC-7	12.77	12.37	9.73	8.78	8.07	7.20	6.76	6.03	5.45	5.51 /	8.88
GHLC-8	12.45	12.40	10.04	8.86	8.12	7.24	6.75	6.06	5.48	5.56 /	8.85
GHLC-9	12.26	12.15	9.50	8.70	8.01	7.05	6.71	6.07	5.49	5.55 /	8.83
GHLC-10	12.57	12.18	9.66	8.71	7.99	7.19	6.76	6.04	5.47	5.52 /	8.80
GHLC-11	12.36	11.88	9.49	8.69	7.77	7.16	6.66	6.04	5.50	5.52 /	8.66
GHLC-12	11.95	11.65	9.66	8.72	7.70	7.15	6.72	5.95	5.50	5.55 /	8.59
GHLC-13	12.18	11.87	9.81	8.86	7.89	7.19	6.76	5.99	5.49	5.58 /	8.82
GHLC-14	12.25	11.99	9.61	8.68	7.87	7.14	6.79	6.03	5.51	5.58 /	8.59
GHLC-15	12.25	11.91	9.68	8.71	7.84	7.08	6.76	6.02	5.51	5.56 /	8.60
GHLC-16	12.29	11.86	9.69	8.75	7.85	7.17	6.77	5.99	5.51	5.57 /	8.57
GHLC-17	12.13	11.82	9.67	8.65	7.85	7.16	6.78	6.00	5.54	5.61 /	8.54
GHLC-18	11.96	11.68	9.68	8.81	7.85	7.18	6.76	6.00	5.54	5.61 /	8.51
GHLC-19	11.92	11.63	9.68	8.80	7.80	7.20	6.75	5.98	5.54	5.62 /	8.54
GHLC-20	11.84	11.66	9.42	8.68	7.83	7.13	6.71	5.95	5.57	5.68 /	8.62
GHLC-21	11.80	11.41	9.53	8.81	7.88	7.21	6.69	5.94	5.59	5.72 /	8.60
GHLC-22	12.02	11.63	9.45	8.64	7.80	7.15	6.75	5.97	5.59	5.78 /	8.54
GHLC-23	12.10	11.66	9.43	8.68	7.90	7.15	6.76	5.98	5.60	5.78 /	8.61
GHLC-24	12.00	11.54	9.39	8.68	7.85	7.13	6.74	5.96	5.63	5.83 /	8.80
GHLC-25	12.02	11.13	9.18	8.68	7.76	7.09	6.65	5.94	5.67	5.81 /	8.83
GHLC-26	11.66	10.93	9.23	8.51	7.59	7.07	6.58	5.85	5.59	5.69 /	8.78
GHLC-27	11.00	10.62	8.95	8.29	7.54	6.93	6.53	5.90	5.73	5.77 /	8.89
GHLC-28	11.56	11.01	9.03	8.32	7.60	6.99	6.57	5.88	5.65	5.75 /	8.87
GHLC-29	10.84	10.46	8.99	8.17	7.54	6.87	6.52	5.91	5.75	5.81 /	8.80
GHLC-30	10.54	10.20	8.92	8.08	7.48	6.86	6.51	5.96	5.82	5.86 /	9.35
GHLC-31	10.43	10.12	8.92	8.19	7.45	6.79	6.45	5.89	5.77	5.78 /	8.82
GHLC-32	10.15	9.96	8.74	7.94	7.31	6.74	6.42	5.91	5.79	5.78 /	8.96
GHLC-33	10.67	10.22	8.93	8.06	7.43	6.84	6.48	5.90	5.79	5.82 /	8.66
GHLC-34	10.30	9.98	8.79	7.97	7.30	6.75	6.42	5.90	5.79	5.79 /	8.57
GHLC-35	10.46	10.05	8.77	8.00	7.34	6.74	6.43	5.92	5.80	5.79 /	8.52

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-36	10.98	10.38	9.01	8.23	7.55	6.92	6.51	5.95	5.83	5.85 / 8.54
GHLC-37	10.82	10.22	9.00	8.10	7.48	6.86	6.48	5.94	5.83	5.84 / 8.58
GHLC-38	11.04	10.60	9.05	8.17	7.59	6.89	6.55	5.97	5.84	5.90 / 8.96
GHLC-39	11.28	10.39	9.04	8.21	7.54	6.94	6.51	5.97	5.84	5.88 / 8.88
GHLC-40	11.44	10.72	9.23	8.47	7.70	7.06	6.61	6.02	5.84	5.92 / 8.96
GHLC-41	11.02	10.53	9.06	8.19	7.57	6.87	6.43	5.98	5.86	5.89 / 9.07
GHLC-42	11.70	10.98	9.20	8.38	7.68	7.10	6.61	6.06	5.90	5.96 / 9.10
GHLC-43	11.85	11.48	9.25	8.43	7.80	7.17	6.59	6.07	5.87	6.03 / 9.10
GHLC-44	12.77	12.34	9.56	8.70	8.02	7.34	6.69	6.16	5.90	6.16 / 9.11
GHLC-45	12.29	11.86	9.52	8.63	7.88	7.26	6.66	6.15	5.92	6.09 / 9.13
GHLC-46	12.45	12.01	9.48	8.64	7.91	7.24	6.70	6.16	5.93	6.12 / 9.14
GHLC-47	12.66	12.02	9.42	8.57	7.90	7.29	6.68	6.18	5.95	6.14 / 9.17
GHLC-48	11.68	11.25	9.25	8.38	7.68	7.19	6.64	6.10	5.94	6.00 / 9.17
GHLC-49	11.88	11.24	9.21	8.30	7.65	7.17	6.54	6.08	5.92	6.01 / 9.18
GHLC-50	12.58	12.28	9.57	8.68	7.88	7.31	6.82	6.21	5.99	6.15 / 9.19
GHLC-51	12.23	11.62	9.25	8.38	7.70	7.20	6.60	6.11	5.95	6.05 / 9.20
GHLC-52	11.94	11.04	9.27	8.30	7.60	7.13	6.64	6.10	5.95	6.01 / 9.22
GHLC-53	11.96	11.30	9.37	8.41	7.67	7.17	6.71	6.15	5.99	6.06 / 9.23
JHF-S1	12.34	11.66	9.92	8.87	8.06	7.10	6.55	6.13	5.52	5.39 / 9.80
JHF-S2	12.12	11.68	9.95	8.88	8.04	7.00	6.58	6.12	5.53	5.39 / 9.84
JHF-S3	11.90	11.71	10.05	8.93	8.06	7.04	6.58	6.14	5.54	5.39 / 9.88
JHF-S4	11.96	11.65	9.88	8.76	7.93	6.96	6.65	6.08	5.57	5.44 / 9.54
JHF-S5	11.74	11.44	9.66	8.73	7.71	6.88	6.65	5.98	5.59	5.41 / 9.39
JHF-S6	11.82	11.55	9.75	8.75	7.76	6.90	6.65	6.00	5.58	5.43 / 9.46
JHF-S7	11.92	11.64	9.72	8.75	7.74	6.93	6.67	6.01	5.58	5.42 / 9.48
JHF-S8	10.91	10.53	9.15	8.09	7.37	6.86	6.58	5.84	5.60	5.45 / 9.06
JHF-S9	10.94	10.55	9.16	8.09	7.39	6.87	6.59	5.85	5.61	5.46 / 9.07
GHLC-S1	12.49	12.24	9.70	8.73	8.08	7.12	6.65	5.92	5.33	5.40 / 8.85
GHLC-S2	12.45	12.22	9.69	8.75	8.02	7.12	6.61	5.92	5.33	5.37 / 8.82
GHLC-S3	12.50	12.02	9.86	8.80	8.06	7.13	6.62	5.99	5.35	5.42 / 8.76
GHLC-S4	12.51	12.13	10.12	8.99	8.12	7.16	6.63	6.07	5.42	5.40 / 9.12
GHLC-S5	12.50	12.28	10.35	9.08	8.05	7.14	6.61	6.08	5.41	5.38 / 9.16
GHLC-S6	12.21	11.73	10.03	8.93	8.11	7.24	6.60	6.05	5.45	5.38 / 9.59
GHLC-S7	12.55	11.89	10.05	8.94	8.05	7.19	6.58	6.05	5.45	5.39 / 9.61
GHLC-S8	12.23	12.05	10.05	8.94	8.08	7.19	6.57	6.06	5.44	5.36 / 9.64
GHLC-S9	12.34	11.85	10.07	8.94	8.07	7.16	6.56	6.05	5.43	5.36 / 9.67
GHLC-S10	12.15	11.73	9.87	8.89	8.08	7.19	6.56	6.05	5.45	5.35 / 9.70

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。