

P S J 予測統計値  
(中央値)

2007年 11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`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,日興シ`ェイク`グループ												
回号	Yield Curve Scenarios ( % )										最低 / 最高(%)	
	-300bp	-200bp	-100bp	-50bp	0bp	50bp	100bp	200bp	300bp			
JHF-1	13.80	13.04	10.36	9.38	8.90	8.23	7.87	7.39	7.24	7.78 / 10.22		
JHF-2	13.77	13.06	10.23	9.36	8.92	8.29	7.87	7.43	7.28	7.79 / 10.23		
JHF-3	14.04	13.27	10.31	9.42	8.96	8.26	7.81	7.40	7.27	7.85 / 10.25		
JHF-4	14.18	13.67	10.38	9.48	9.00	8.39	7.90	7.47	7.28	7.87 / 10.30		
JHF-5	14.62	14.12	10.55	9.61	9.06	8.37	7.89	7.41	7.26	7.90 / 10.38		
JHF-6	14.35	13.82	10.41	9.50	8.97	8.33	7.85	7.37	7.28	7.72 / 10.38		
JHF-7	13.82	12.96	10.28	9.42	9.03	8.29	7.85	7.40	7.22	7.64 / 10.22		
GHLC-1	13.66	13.09	10.55	9.24	7.94	7.19	6.72	5.94	5.35	5.44 / 9.35		
GHLC-2	13.14	12.73	10.56	9.19	7.96	7.21	6.57	5.94	5.38	5.49 / 9.20		
GHLC-3	13.23	12.90	10.71	9.10	7.96	7.18	6.57	5.98	5.41	5.54 / 9.18		
GHLC-4	12.99	12.37	9.77	8.71	7.66	7.01	6.47	5.90	5.44	5.66 / 9.06		
GHLC-5	12.86	12.23	9.47	8.61	7.59	6.98	6.49	5.86	5.49	5.78 / 8.95		
GHLC-6	13.07	12.32	9.70	8.65	7.67	7.01	6.51	5.88	5.56	5.88 / 8.94		
GHLC-7	13.06	12.47	9.98	8.71	7.61	7.00	6.59	5.84	5.53	5.93 / 8.97		
GHLC-8	13.11	12.38	9.87	8.50	7.67	7.00	6.57	5.88	5.57	6.00 / 8.87		
GHLC-9	12.86	12.27	9.63	8.35	7.64	6.95	6.49	5.89	5.61	6.03 / 8.84		
GHLC-10	12.74	12.30	9.80	8.41	7.60	6.93	6.57	5.86	5.61	6.09 / 8.80		
GHLC-11	12.34	12.11	9.59	8.40	7.55	6.90	6.51	5.87	5.64	6.12 / 8.72		
GHLC-12	12.04	11.86	9.48	8.26	7.47	6.92	6.42	5.86	5.66	6.22 / 8.64		
GHLC-13	12.30	12.12	9.48	8.39	7.57	6.91	6.45	5.88	5.68	6.28 / 8.84		
GHLC-14	12.29	12.21	9.66	8.31	7.53	6.83	6.49	5.90	5.67	6.19 / 8.48		
GHLC-15	12.24	12.18	9.64	8.25	7.51	6.83	6.47	5.88	5.68	6.23 / 8.50		
GHLC-16	12.27	12.08	9.49	8.32	7.52	6.91	6.44	5.89	5.68	6.25 / 8.68		
GHLC-17	12.15	12.04	9.31	8.30	7.48	6.88	6.45	5.91	5.70	6.28 / 8.47		
GHLC-18	12.00	11.72	9.20	8.37	7.53	6.87	6.43	5.91	5.70	6.25 / 8.51		
GHLC-19	11.99	11.71	9.18	8.15	7.53	6.91	6.44	5.91	5.70	6.31 / 8.53		
GHLC-20	12.20	11.83	9.46	8.21	7.44	6.88	6.40	5.93	5.72	6.36 / 8.63		
GHLC-21	12.51	11.83	9.38	8.37	7.58	6.94	6.42	5.95	5.79	6.44 / 8.69		
GHLC-22	12.55	12.06	9.45	8.34	7.46	6.82	6.47	5.97	5.79	6.49 / 8.49		
GHLC-23	12.64	12.07	9.51	8.29	7.48	6.86	6.47	5.99	5.81	6.52 / 8.59		
GHLC-24	12.59	11.92	9.42	8.24	7.44	6.84	6.48	6.00	5.85	6.55 / 8.93		
GHLC-25	12.29	11.52	9.24	8.10	7.35	6.82	6.46	6.01	5.88	6.58 / 9.04		
GHLC-26	11.78	11.52	9.11	7.98	7.32	6.84	6.37	5.92	5.79	6.48 / 8.56		
GHLC-27	11.50	10.84	8.75	7.89	7.26	6.67	6.38	6.06	5.94	6.58 / 9.02		
GHLC-28	11.93	11.37	9.09	7.91	7.25	6.79	6.42	6.00	5.87	6.56 / 9.30		
GHLC-29	11.42	10.86	8.58	7.85	7.34	6.66	6.37	6.10	5.97	6.56 / 8.78		
GHLC-30	11.14	10.29	8.48	7.78	7.30	6.66	6.42	6.14	6.00	6.51 / 9.46		
GHLC-31	10.95	10.44	8.40	7.70	7.21	6.60	6.34	6.09	5.96	6.40 / 8.85		
GHLC-32	10.69	10.19	8.31	7.59	7.09	6.61	6.30	6.08	5.96	6.34 / 8.85		
GHLC-33	11.06	10.60	8.46	7.71	7.16	6.66	6.35	6.12	5.99	6.44 / 9.00		
GHLC-34	10.77	10.31	8.30	7.54	7.06	6.61	6.31	6.11	5.99	6.31 / 8.69		
GHLC-35	10.81	10.42	8.27	7.46	6.98	6.65	6.32	6.12	5.99	6.33 / 8.58		
GHLC-36	11.64	10.48	8.60	7.82	7.24	6.73	6.41	6.15	6.01	6.48 / 8.63		
GHLC-37	11.40	10.81	8.52	7.67	7.12	6.71	6.40	6.14	6.02	6.42 / 8.54		
GHLC-38	11.66	11.12	8.72	7.75	7.19	6.78	6.44	6.15	6.02	6.52 / 8.60		
GHLC-39	11.62	11.00	8.67	7.81	7.25	6.79	6.44	6.18	6.04	6.46 / 8.88		
GHLC-40	12.07	11.22	9.04	8.02	7.34	6.88	6.50	6.17	6.03	6.65 / 8.67		
GHLC-41	11.43	10.85	8.58	7.73	7.17	6.80	6.44	6.19	6.05	6.47 / 8.93		
GHLC-42	12.01	11.25	8.95	7.96	7.38	6.93	6.54	6.24	6.09	6.63 / 9.29		
GHLC-43	12.35	11.58	9.10	8.05	7.32	6.94	6.55	6.22	6.08	6.72 / 9.22		
GHLC-44	13.12	12.67	9.47	8.35	7.51	7.07	6.68	6.26	6.12	6.90 / 9.28		

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	12.70	12.07	9.34	8.23	7.44	7.03	6.64	6.27	6.13	6.77 /	9.14
GHLC-46	12.78	12.25	9.36	8.23	7.46	7.03	6.67	6.28	6.13	6.80 /	9.25
GHLC-47	12.85	12.34	9.36	8.23	7.50	7.05	6.67	6.30	6.15	6.79 /	9.55
GHLC-48	12.22	11.47	9.00	7.98	7.36	6.97	6.59	6.27	6.12	6.60 /	9.54
GHLC-49	12.35	11.58	8.85	7.97	7.37	6.97	6.55	6.26	6.11	6.61 /	9.63
GHLC-50	12.87	12.32	9.39	8.21	7.52	7.07	6.75	6.33	6.18	6.76 /	9.69
GHLC-51	12.64	12.09	9.00	8.01	7.41	6.98	6.62	6.30	6.15	6.66 /	9.80
GHLC-52	12.62	11.75	8.94	7.90	7.32	6.94	6.60	6.30	6.15	6.58 /	9.71
GHLC-53	12.51	11.80	9.04	7.97	7.38	6.98	6.73	6.34	6.19	6.67 /	9.11
JHF-S1	12.74	12.01	9.82	8.79	7.71	6.95	6.50	5.88	5.58	5.79 /	9.76
JHF-S2	12.71	11.98	9.75	8.78	7.69	6.93	6.51	5.89	5.58	5.80 /	9.78
JHF-S3	12.72	12.01	9.79	8.80	7.69	6.94	6.52	5.90	5.58	5.80 /	9.82
JHF-S4	12.46	11.84	9.59	8.68	7.49	6.80	6.53	5.92	5.71	5.99 /	9.56
GHLC-S1	12.81	12.27	10.41	8.99	7.95	7.11	6.50	5.96	5.36	5.49 /	9.18
GHLC-S2	12.76	12.26	10.42	8.99	7.92	7.12	6.52	5.98	5.37	5.52 /	9.24
GHLC-S3	12.77	12.30	10.41	9.00	7.91	7.11	6.52	6.00	5.40	5.56 /	9.28
GHLC-S4	12.71	12.16	10.23	8.99	8.03	7.09	6.52	5.98	5.44	5.61 /	9.46
GHLC-S5	12.87	12.52	10.47	8.95	7.99	7.05	6.70	5.98	5.43	5.58 /	9.46
GHLC-S6	12.73	12.07	10.09	8.92	7.94	6.97	6.49	5.93	5.52	5.68 /	9.71
GHLC-S7	12.72	12.09	10.08	8.77	7.89	6.95	6.49	5.94	5.52	5.69 /	9.72
GHLC-S8	12.71	12.06	10.00	8.84	7.89	6.92	6.47	5.92	5.51	5.68 /	9.77
GHLC-S9	12.66	12.02	10.00	8.75	7.82	6.91	6.46	5.92	5.51	5.69 /	9.78
GHLC-S10	12.63	12.01	10.12	8.74	7.80	6.92	6.47	5.92	5.51	5.68 /	9.81

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。