

P S J 予測統計値
(中央値)

2007年 12月 17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・ハート・スタンズ,みずほ,UBS,メリル・ピッチ日本,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	13.99	13.39	10.61	9.52	8.88	8.24	7.94	7.33	7.16	7.83 / 10.24	
JHF-2	13.73	13.39	10.49	9.48	8.81	8.22	7.85	7.33	7.16	7.82 / 10.23	
JHF-3	14.05	13.54	10.50	9.57	8.92	8.29	7.79	7.36	7.18	7.87 / 10.25	
JHF-4	14.30	13.72	10.66	9.63	8.98	8.34	7.89	7.39	7.22	7.91 / 10.30	
JHF-5	14.53	14.08	10.76	9.76	9.00	8.38	7.97	7.34	7.21	7.98 / 10.38	
JHF-6	14.26	13.88	10.62	9.57	8.89	8.34	7.92	7.29	7.20	7.80 / 10.38	
JHF-7	13.75	13.20	10.45	9.56	8.85	8.30	7.81	7.38	7.21	7.78 / 10.28	
JHF-8	14.23	13.83	10.59	9.41	8.77	8.36	7.92	7.27	7.22	7.71 / 10.40	
GHLC-1	12.97	12.73	10.82	9.40	8.13	7.32	6.66	6.01	5.36	5.45 / 9.79	
GHLC-2	13.11	12.83	10.74	9.28	8.07	7.29	6.63	6.02	5.37	5.52 / 9.03	
GHLC-3	13.10	12.93	10.93	9.18	8.12	7.26	6.62	6.06	5.40	5.57 / 9.08	
GHLC-4	13.17	12.43	9.98	8.88	7.77	7.08	6.56	5.98	5.42	5.56 / 9.11	
GHLC-5	12.98	12.21	9.65	8.70	7.74	7.03	6.59	5.93	5.45	5.64 / 8.99	
GHLC-6	12.99	12.47	9.92	8.67	7.83	7.08	6.57	5.94	5.54	5.76 / 8.98	
GHLC-7	12.99	12.42	10.21	8.74	7.76	7.10	6.65	5.92	5.54	5.77 / 8.98	
GHLC-8	13.05	12.46	10.10	8.70	7.85	7.10	6.63	5.93	5.58	5.83 / 8.91	
GHLC-9	12.83	12.34	9.69	8.53	7.73	7.05	6.55	5.90	5.61	5.89 / 8.88	
GHLC-10	12.67	12.25	9.86	8.72	7.76	7.04	6.64	5.86	5.62	5.94 / 8.82	
GHLC-11	12.38	11.98	9.61	8.48	7.65	7.01	6.58	5.84	5.64	5.97 / 8.77	
GHLC-12	12.01	11.87	9.63	8.43	7.58	7.04	6.48	5.91	5.66	6.06 / 8.66	
GHLC-13	12.11	12.02	9.47	8.25	7.68	7.01	6.52	5.91	5.68	6.08 / 8.85	
GHLC-14	12.24	12.21	9.84	8.50	7.63	6.96	6.57	5.92	5.67	6.04 / 8.53	
GHLC-15	12.19	12.15	9.70	8.48	7.59	6.97	6.53	5.92	5.66	6.06 / 8.55	
GHLC-16	12.08	12.01	9.48	8.37	7.59	6.97	6.51	5.92	5.67	6.07 / 8.70	
GHLC-17	12.10	11.82	9.44	8.30	7.58	6.96	6.51	5.94	5.69	6.11 / 8.50	
GHLC-18	11.96	11.65	9.36	8.37	7.60	6.98	6.51	5.93	5.69	6.13 / 8.62	
GHLC-19	12.33	11.91	9.62	8.55	7.72	7.01	6.50	5.95	5.69	6.14 / 8.54	
GHLC-20	12.14	11.82	9.59	8.54	7.58	6.96	6.46	5.97	5.73	6.20 / 8.55	
GHLC-21	12.44	11.97	9.55	8.44	7.71	7.03	6.44	5.99	5.81	6.25 / 8.70	
GHLC-22	12.50	12.09	9.60	8.56	7.61	6.91	6.51	5.99	5.80	6.31 / 8.54	
GHLC-23	12.58	12.18	9.68	8.56	7.62	6.97	6.50	6.02	5.82	6.31 / 8.64	
GHLC-24	12.55	11.98	9.59	8.41	7.58	6.93	6.49	6.02	5.86	6.37 / 8.71	
GHLC-25	12.28	11.59	9.33	8.28	7.49	6.93	6.45	6.02	5.88	6.40 / 9.23	
GHLC-26	11.73	11.55	9.28	8.16	7.43	6.92	6.34	5.95	5.81	6.28 / 8.75	
GHLC-27	11.28	10.92	8.96	7.98	7.36	6.74	6.37	6.07	5.94	6.44 / 8.62	
GHLC-28	11.87	11.38	9.22	8.07	7.37	6.90	6.34	6.00	5.87	6.38 / 8.57	
GHLC-29	11.52	10.87	8.81	7.94	7.44	6.72	6.38	6.09	5.96	6.49 / 8.79	
GHLC-30	11.12	10.41	8.70	7.90	7.37	6.66	6.49	6.16	6.02	6.54 / 9.56	
GHLC-31	10.89	10.50	8.58	7.83	7.31	6.59	6.39	6.09	5.96	6.41 / 8.87	
GHLC-32	10.71	10.19	8.45	7.73	7.18	6.55	6.34	6.08	5.96	6.33 / 8.49	
GHLC-33	11.03	10.47	8.60	7.87	7.25	6.69	6.40	6.10	5.99	6.46 / 8.55	
GHLC-34	10.75	10.32	8.45	7.68	7.14	6.55	6.37	6.11	5.99	6.32 / 8.47	
GHLC-35	10.79	10.45	8.48	7.58	7.06	6.63	6.39	6.11	5.99	6.33 / 8.51	
GHLC-36	11.51	10.88	8.73	7.93	7.34	6.79	6.47	6.15	6.02	6.50 / 8.73	
GHLC-37	11.46	10.90	8.64	7.82	7.22	6.77	6.45	6.14	6.02	6.43 / 8.55	
GHLC-38	11.63	11.02	8.89	7.88	7.23	6.80	6.48	6.15	6.02	6.54 / 8.61	
GHLC-39	11.89	10.64	8.79	7.95	7.34	6.87	6.49	6.17	6.03	6.46 / 8.89	
GHLC-40	12.43	11.42	9.16	8.15	7.46	7.00	6.48	6.17	6.04	6.60 / 8.68	
GHLC-41	11.27	10.84	8.73	7.82	7.22	6.82	6.46	6.19	6.05	6.48 / 8.94	
GHLC-42	12.09	11.45	9.08	8.09	7.49	7.04	6.59	6.25	6.11	6.64 / 9.38	
GHLC-43	12.56	11.59	9.22	8.14	7.38	6.97	6.56	6.21	6.07	6.68 / 8.77	

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・ピッチ日本、大和SMBC、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		
GHLC-44	13.09	12.74	9.58	8.51	7.61	7.02	6.63	6.26	6.12	6.75 /	8.91
GHLC-45	12.79	12.15	9.45	8.35	7.53	7.05	6.64	6.27	6.13	6.73 /	8.84
GHLC-46	12.78	12.37	9.47	8.37	7.58	7.11	6.66	6.28	6.13	6.76 /	8.92
GHLC-47	12.82	12.42	9.49	8.40	7.62	7.00	6.67	6.14	5.89	6.80 /	8.99
GHLC-48	12.48	11.70	9.25	8.12	7.44	6.94	6.61	6.07	5.86	6.65 /	8.74
GHLC-49	12.35	11.60	9.10	8.11	7.44	6.90	6.57	6.06	5.84	6.63 /	8.74
GHLC-50	12.94	12.54	9.50	8.41	7.62	7.04	6.76	6.12	5.89	6.79 /	9.06
GHLC-51	12.47	12.12	9.26	8.16	7.51	6.97	6.62	6.08	5.83	6.70 /	8.81
GHLC-52	12.41	11.66	9.16	8.06	7.42	6.96	6.59	6.05	5.82	6.59 /	8.76
GHLC-53	12.78	11.84	9.29	8.15	7.48	7.04	6.67	6.07	5.84	6.67 /	9.09
JHF-S1	12.64	12.05	10.08	8.96	7.87	7.03	6.55	5.93	5.51	5.66 /	9.79
JHF-S2	12.62	12.02	9.89	8.94	7.85	7.02	6.55	5.93	5.51	5.64 /	9.82
JHF-S3	12.62	12.04	9.99	8.96	7.84	7.03	6.56	5.95	5.52	5.65 /	9.87
JHF-S4	12.43	11.89	9.82	8.80	7.58	6.88	6.58	5.94	5.60	5.82 /	9.62
GHLC-S1	13.07	12.26	10.55	9.22	8.12	7.19	6.58	6.05	5.43	5.41 /	9.00
GHLC-S2	12.64	12.19	10.59	9.25	8.07	7.19	6.57	6.05	5.44	5.42 /	9.08
GHLC-S3	12.75	12.23	10.56	9.23	8.07	7.17	6.60	6.07	5.46	5.46 /	9.20
GHLC-S4	12.93	12.25	10.41	9.23	8.19	7.24	6.54	6.03	5.45	5.51 /	9.64
GHLC-S5	12.75	12.44	10.71	9.13	8.16	7.22	6.75	6.04	5.45	5.50 /	9.64
GHLC-S6	12.70	12.10	10.21	9.06	8.12	7.11	6.54	5.99	5.49	5.55 /	9.85
GHLC-S7	12.63	12.13	10.23	8.99	8.09	7.08	6.52	6.01	5.49	5.55 /	9.86
GHLC-S8	12.66	12.10	10.24	8.99	8.05	7.03	6.52	5.98	5.48	5.55 /	9.91
GHLC-S9	12.59	12.09	10.25	9.00	8.01	7.04	6.50	5.99	5.49	5.55 /	9.92
GHLC-S10	12.54	12.06	10.15	8.96	7.99	6.99	6.52	5.98	5.48	5.55 /	9.95

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。