

PSJ 予測統計値
(平均値)

2008年 1月 4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・スチール・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	15.52	14.48	11.01	9.78	8.98	8.47	8.10	7.53	7.17	7.89 / 10.25		
JHF-2	15.52	14.40	10.98	9.78	8.95	8.45	8.09	7.52	7.17	7.85 / 10.24		
JHF-3	15.76	14.62	11.09	9.85	8.99	8.48	8.11	7.53	7.19	7.92 / 10.26		
JHF-4	16.08	14.97	11.27	9.94	9.08	8.55	8.18	7.58	7.23	7.96 / 10.30		
JHF-5	16.47	15.42	11.46	9.97	9.09	8.51	8.14	7.52	7.15	7.95 / 10.40		
JHF-6	16.26	15.11	11.26	9.90	9.02	8.46	8.09	7.48	7.12	7.75 / 10.40		
JHF-7	15.43	14.21	10.85	9.73	8.95	8.47	8.10	7.54	7.19	7.83 / 10.30		
JHF-8	16.21	15.07	11.13	9.88	8.99	8.48	8.13	7.53	7.17	7.69 / 10.41		
JHF-9	15.65	14.46	10.85	9.72	8.93	8.44	8.07	7.50	7.15	7.61 / 10.32		
GHLC-1	13.18	12.64	10.57	8.97	7.68	6.90	6.38	5.80	5.44	5.34 / 9.97		
GHLC-2	13.89	13.35	10.81	9.13	7.86	7.07	6.58	5.99	5.61	5.55 / 9.18		
GHLC-3	13.86	13.31	10.74	9.03	7.82	7.08	6.60	6.01	5.64	5.61 / 9.05		
GHLC-4	13.33	12.79	10.27	8.70	7.68	7.04	6.60	6.05	5.69	5.58 / 9.11		
GHLC-5	13.26	12.73	10.13	8.67	7.67	7.04	6.61	6.06	5.70	5.67 / 8.99		
GHLC-6	13.45	12.90	10.22	8.77	7.75	7.10	6.67	6.12	5.76	5.78 / 8.98		
GHLC-7	13.54	12.92	10.24	8.81	7.78	7.14	6.72	6.16	5.80	5.80 / 9.00		
GHLC-8	13.57	12.97	10.23	8.81	7.77	7.15	6.72	6.16	5.80	5.88 / 8.94		
GHLC-9	13.19	12.56	10.01	8.65	7.66	7.06	6.65	6.11	5.76	5.91 / 8.88		
GHLC-10	13.02	12.41	9.91	8.54	7.64	7.08	6.67	6.15	5.80	5.94 / 8.81		
GHLC-11	12.84	12.17	9.70	8.38	7.56	7.03	6.63	6.11	5.77	5.98 / 8.78		
GHLC-12	12.65	11.97	9.44	8.26	7.50	7.00	6.62	6.13	5.79	6.08 / 8.69		
GHLC-13	12.80	12.17	9.58	8.39	7.57	7.05	6.67	6.16	5.83	6.10 / 8.98		
GHLC-14	12.89	12.27	9.66	8.36	7.54	7.01	6.62	6.12	5.78	6.05 / 8.55		
GHLC-15	12.83	12.18	9.60	8.33	7.53	7.02	6.62	6.13	5.79	6.07 / 8.57		
GHLC-16	12.78	12.12	9.53	8.30	7.53	7.02	6.64	6.14	5.81	6.09 / 8.73		
GHLC-17	12.74	12.06	9.47	8.33	7.52	7.01	6.63	6.14	5.81	6.12 / 8.51		
GHLC-18	12.73	12.04	9.42	8.26	7.51	7.00	6.63	6.15	5.82	6.15 / 8.65		
GHLC-19	12.83	12.12	9.58	8.37	7.53	7.03	6.65	6.16	5.83	6.16 / 8.66		
GHLC-20	12.95	12.24	9.63	8.44	7.54	7.01	6.64	6.14	5.81	6.22 / 8.62		
GHLC-21	12.94	12.25	9.60	8.43	7.58	7.07	6.70	6.20	5.87	6.26 / 8.72		
GHLC-22	12.99	12.31	9.63	8.39	7.55	7.03	6.65	6.16	5.83	6.32 / 8.56		
GHLC-23	13.21	12.50	9.72	8.50	7.59	7.05	6.68	6.17	5.84	6.32 / 8.64		
GHLC-24	13.20	12.49	9.71	8.47	7.60	7.06	6.68	6.18	5.85	6.38 / 8.76		
GHLC-25	12.99	12.25	9.63	8.44	7.58	7.02	6.64	6.14	5.80	6.41 / 9.50		
GHLC-26	12.56	11.82	9.31	8.26	7.46	6.97	6.62	6.15	5.83	6.29 / 8.87		
GHLC-27	12.30	11.45	9.11	8.10	7.37	6.92	6.59	6.13	5.83	6.45 / 8.69		
GHLC-28	12.68	11.88	9.29	8.23	7.44	6.96	6.62	6.13	5.82	6.38 / 8.73		
GHLC-29	12.12	11.32	9.05	8.10	7.39	6.96	6.63	6.17	5.87	6.49 / 8.81		
GHLC-30	12.09	11.28	9.10	8.17	7.47	7.04	6.71	6.25	5.95	6.54 / 9.58		
GHLC-31	11.83	11.01	8.94	8.03	7.34	6.94	6.61	6.17	5.87	6.49 / 8.97		
GHLC-32	11.47	10.63	8.70	7.86	7.22	6.83	6.51	6.08	5.79	6.40 / 8.49		
GHLC-33	11.83	11.06	8.89	7.92	7.30	6.90	6.57	6.12	5.82	6.53 / 8.57		
GHLC-34	11.42	10.62	8.64	7.77	7.21	6.84	6.51	6.09	5.80	6.37 / 8.47		
GHLC-35	11.59	10.72	8.71	7.83	7.22	6.84	6.52	6.09	5.79	6.39 / 8.51		
GHLC-36	12.16	11.33	8.99	8.02	7.36	6.95	6.62	6.16	5.86	6.55 / 8.74		
GHLC-37	11.95	11.12	8.95	7.97	7.31	6.92	6.60	6.14	5.84	6.50 / 8.65		
GHLC-38	12.44	11.62	9.13	8.12	7.36	6.93	6.59	6.12	5.82	6.60 / 8.63		
GHLC-39	12.29	11.43	9.10	8.08	7.39	6.98	6.64	6.18	5.87	6.53 / 8.90		
GHLC-40	13.00	12.11	9.37	8.27	7.50	7.03	6.70	6.20	5.88	6.60 / 8.69		
GHLC-41	12.50	11.55	9.15	8.10	7.41	6.97	6.64	6.16	5.85	6.55 / 8.95		
GHLC-42	13.12	12.23	9.46	8.38	7.57	7.11	6.76	6.26	5.94	6.67 / 9.39		

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、ペアー・スターンズ、みずほ、UBS、メリル・リンチ日本、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-43	13.62	12.68	9.62	8.44	7.57	7.08	6.73	6.20	5.88	6.70 / 8.77	
GHLC-44	14.41	13.52	10.15	8.69	7.73	7.17	6.81	6.25	5.91	6.76 / 8.98	
GHLC-45	14.16	13.27	9.95	8.64	7.70	7.16	6.81	6.25	5.92	6.73 / 8.85	
GHLC-46	14.33	13.41	10.11	8.68	7.76	7.19	6.82	6.26	5.91	6.77 / 9.16	
GHLC-47	14.33	13.40	10.07	8.61	7.73	7.13	6.75	6.19	5.84	6.80 / 9.08	
GHLC-48	13.50	12.54	9.59	8.38	7.60	7.07	6.70	6.18	5.84	6.72 / 8.76	
GHLC-49	13.57	12.56	9.54	8.37	7.58	7.05	6.69	6.17	5.83	6.71 / 8.96	
GHLC-50	14.52	13.52	10.11	8.71	7.82	7.22	6.84	6.27	5.92	6.79 / 9.14	
GHLC-51	13.95	12.91	9.68	8.41	7.63	7.10	6.74	6.19	5.86	6.77 / 8.91	
GHLC-52	13.65	12.61	9.57	8.39	7.61	7.11	6.76	6.24	5.91	6.65 / 8.77	
GHLC-53	14.01	12.98	9.74	8.51	7.70	7.18	6.83	6.29	5.94	6.72 / 9.11	
JHF-S1	13.43	12.80	10.26	8.82	7.79	7.15	6.70	6.16	5.80	5.67 / 9.79	
JHF-S2	13.37	12.82	10.25	8.81	7.79	7.15	6.71	6.17	5.81	5.67 / 9.82	
JHF-S3	13.42	12.81	10.26	8.85	7.80	7.16	6.71	6.17	5.81	5.67 / 9.87	
JHF-S4	13.18	12.56	9.96	8.64	7.68	7.10	6.69	6.18	5.83	5.83 / 9.62	
JHF-S5	13.08	12.49	9.93	8.60	7.67	7.12	6.71	6.19	5.85	5.88 / 9.78	
GHLC-S1	13.59	13.00	10.61	9.01	7.78	7.00	6.50	5.91	5.53	5.46 / 8.97	
GHLC-S2	13.59	13.01	10.58	8.97	7.78	7.00	6.51	5.92	5.54	5.45 / 9.06	
GHLC-S3	13.65	13.05	10.62	9.00	7.80	7.03	6.55	5.97	5.59	5.50 / 9.19	
GHLC-S4	13.58	13.03	10.51	8.94	7.82	7.11	6.63	6.06	5.68	5.53 / 9.62	
GHLC-S5	13.60	13.01	10.50	8.99	7.83	7.12	6.65	6.07	5.70	5.52 / 9.63	
GHLC-S6	13.51	12.92	10.39	8.91	7.80	7.13	6.67	6.10	5.74	5.59 / 9.84	
GHLC-S7	13.45	12.89	10.34	8.87	7.80	7.12	6.66	6.10	5.73	5.58 / 9.85	
GHLC-S8	13.50	12.90	10.35	8.86	7.80	7.12	6.67	6.10	5.74	5.57 / 9.91	
GHLC-S9	13.43	12.86	10.35	8.84	7.78	7.11	6.66	6.10	5.73	5.57 / 9.91	
GHLC-S10	13.41	12.84	10.33	8.82	7.78	7.11	6.65	6.09	5.73	5.56 / 9.94	

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。