

P S J 予測統計値  
(平均値)

2008年 6月 16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	14.39	12.74	9.78	8.97	8.52	8.15	7.90	7.51	7.21	7.48 /	9.88
JHF-2	14.30	12.61	9.71	8.94	8.46	8.12	7.86	7.47	7.18	7.47 /	9.88
JHF-3	14.52	12.80	9.76	9.02	8.51	8.15	7.89	7.49	7.20	7.51 /	9.88
JHF-4	14.74	13.00	9.85	9.09	8.57	8.20	7.93	7.53	7.24	7.53 /	9.91
JHF-5	15.21	13.47	9.97	9.08	8.59	8.19	7.91	7.49	7.20	7.54 /	9.98
JHF-6	15.04	13.21	9.83	9.02	8.55	8.15	7.89	7.47	7.18	7.40 /	9.98
JHF-7	14.13	12.30	9.64	8.90	8.49	8.15	7.90	7.51	7.22	7.54 /	9.90
JHF-8	14.96	13.11	9.78	8.99	8.49	8.14	7.87	7.47	7.18	7.34 /	10.00
JHF-9	14.42	12.47	9.64	8.93	8.47	8.12	7.87	7.47	7.18	7.35 /	9.95
JHF-10	13.81	11.91	9.50	8.88	8.45	8.14	7.90	7.52	7.23	7.56 /	9.90
JHF-11	14.64	12.58	9.75	9.05	8.56	8.23	7.98	7.59	7.29	7.61 /	9.96
JHF-12	14.53	12.48	9.78	9.02	8.58	8.26	8.01	7.62	7.32	7.63 /	9.98
JHF-13	15.25	13.18	10.05	9.15	8.64	8.33	8.08	7.68	7.39	7.64 /	10.33
JHF-14	14.75	12.69	9.84	8.99	8.54	8.26	8.01	7.63	7.33	7.63 /	9.98
GHLC-1	12.89	12.17	9.02	7.87	7.09	6.51	6.14	5.68	5.38	4.92 /	8.55
GHLC-2	12.98	12.19	9.02	7.91	7.11	6.54	6.17	5.72	5.42	4.97 /	9.09
GHLC-3	13.13	12.37	9.08	7.92	7.13	6.59	6.22	5.77	5.47	5.02 /	9.31
GHLC-4	12.65	11.77	8.83	7.76	7.06	6.59	6.25	5.83	5.52	5.01 /	9.28
GHLC-5	12.58	11.70	8.78	7.85	7.11	6.66	6.33	5.91	5.62	5.08 /	9.01
GHLC-6	12.81	11.93	8.88	7.88	7.19	6.73	6.41	5.99	5.69	5.17 /	9.01
GHLC-7	12.88	11.93	8.91	7.94	7.25	6.80	6.47	6.07	5.77	5.18 /	8.88
GHLC-8	12.97	12.00	8.96	7.94	7.25	6.79	6.47	6.07	5.77	5.25 /	8.90
GHLC-9	12.62	11.70	8.75	7.81	7.15	6.72	6.43	6.02	5.73	5.29 /	8.83
GHLC-10	12.57	11.56	8.72	7.81	7.17	6.76	6.47	6.07	5.78	5.28 /	8.72
GHLC-11	12.45	11.38	8.58	7.71	7.11	6.72	6.44	6.04	5.76	5.32 /	8.65
GHLC-12	12.30	11.21	8.53	7.63	7.11	6.73	6.47	6.09	5.81	5.36 /	8.52
GHLC-13	12.50	11.39	8.60	7.72	7.15	6.77	6.51	6.12	5.83	5.39 /	8.73
GHLC-14	12.52	11.41	8.65	7.71	7.12	6.73	6.46	6.06	5.77	5.37 /	8.32
GHLC-15	12.52	11.42	8.58	7.67	7.12	6.73	6.46	6.07	5.79	5.37 /	8.32
GHLC-16	12.48	11.35	8.59	7.67	7.12	6.75	6.48	6.09	5.82	5.37 /	8.54
GHLC-17	12.46	11.31	8.55	7.65	7.11	6.74	6.48	6.10	5.81	5.43 /	8.30
GHLC-18	12.38	11.29	8.56	7.66	7.10	6.74	6.48	6.11	5.82	5.43 /	8.45
GHLC-19	12.36	11.26	8.56	7.68	7.11	6.74	6.49	6.11	5.83	5.45 /	8.34
GHLC-20	12.31	11.15	8.47	7.71	7.10	6.74	6.48	6.10	5.82	5.49 /	8.19
GHLC-21	12.30	11.15	8.53	7.74	7.15	6.80	6.53	6.15	5.88	5.52 /	8.46
GHLC-22	12.46	11.26	8.52	7.72	7.10	6.75	6.49	6.10	5.83	5.58 /	8.19
GHLC-23	12.53	11.37	8.60	7.74	7.13	6.77	6.50	6.12	5.84	5.58 /	8.26
GHLC-24	12.53	11.26	8.52	7.72	7.15	6.78	6.52	6.14	5.86	5.62 /	8.29
GHLC-25	12.32	11.08	8.43	7.63	7.14	6.75	6.50	6.11	5.84	5.63 /	8.73
GHLC-26	11.85	10.65	8.29	7.55	7.05	6.72	6.47	6.11	5.84	5.54 /	8.25
GHLC-27	11.54	10.30	8.13	7.43	7.00	6.70	6.47	6.12	5.85	5.65 /	8.25
GHLC-28	11.94	10.64	8.24	7.54	7.04	6.71	6.47	6.09	5.83	5.60 /	8.19
GHLC-29	11.44	10.21	8.11	7.52	7.04	6.74	6.51	6.17	5.91	5.69 /	8.55
GHLC-30	11.39	10.21	8.18	7.59	7.12	6.83	6.60	6.26	6.00	5.73 /	9.33
GHLC-31	11.11	9.95	8.01	7.44	7.00	6.73	6.50	6.16	5.90	5.67 /	8.63
GHLC-32	10.80	9.63	7.87	7.31	6.92	6.66	6.43	6.10	5.85	5.70 /	8.13
GHLC-33	11.24	9.97	8.03	7.41	6.97	6.69	6.47	6.13	5.87	5.71 /	8.23
GHLC-34	10.83	9.65	7.85	7.30	6.91	6.65	6.44	6.11	5.85	5.71 /	8.19
GHLC-35	10.96	9.73	7.90	7.34	6.91	6.65	6.43	6.10	5.84	5.71 /	8.18
GHLC-36	11.54	10.21	8.11	7.47	7.02	6.74	6.51	6.16	5.91	5.73 /	8.47
GHLC-37	11.34	10.04	8.04	7.41	6.97	6.70	6.48	6.13	5.87	5.73 /	8.29

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、日興証券グループ

回号	Yield Curve Scenarios ( % )									最低 / 最高( % )
	-300bp	-200bp	-100bp	-50bp	0bp	50bp	100bp	200bp	300bp	
GHLC-38	11.77	10.40	8.15	7.45	7.01	6.70	6.47	6.12	5.85	5.76 / 8.29
GHLC-39	11.62	10.25	8.18	7.49	7.05	6.77	6.54	6.18	5.92	5.77 / 8.64
GHLC-40	12.21	10.79	8.32	7.59	7.11	6.79	6.55	6.19	5.91	5.76 / 8.41
GHLC-41	11.66	10.30	8.18	7.48	7.07	6.76	6.52	6.16	5.90	5.78 / 8.67
GHLC-42	12.28	10.86	8.42	7.69	7.20	6.88	6.62	6.25	5.99	5.82 / 9.12
GHLC-43	12.76	11.28	8.47	7.71	7.16	6.81	6.55	6.18	5.90	5.85 / 8.44
GHLC-44	13.48	12.11	8.81	7.90	7.29	6.90	6.63	6.22	5.94	5.91 / 8.56
GHLC-45	13.24	11.78	8.68	7.82	7.27	6.89	6.62	6.23	5.95	5.87 / 8.51
GHLC-46	13.38	11.88	8.69	7.81	7.29	6.90	6.63	6.23	5.95	5.90 / 8.76
GHLC-47	13.45	11.98	8.71	7.86	7.31	6.91	6.62	6.22	5.93	5.94 / 9.20
GHLC-48	12.64	11.07	8.43	7.70	7.24	6.86	6.61	6.22	5.94	5.86 / 9.20
GHLC-49	12.63	11.06	8.38	7.63	7.17	6.81	6.55	6.17	5.89	5.86 / 9.20
GHLC-50	13.52	11.97	8.74	7.86	7.37	6.96	6.69	6.28	5.99	5.92 / 9.23
GHLC-51	13.00	11.38	8.47	7.68	7.23	6.85	6.60	6.21	5.92	5.89 / 9.09
GHLC-52	12.69	11.07	8.41	7.66	7.22	6.87	6.62	6.24	5.96	5.90 / 8.78
GHLC-53	13.07	11.42	8.56	7.78	7.31	6.94	6.68	6.30	6.01	5.92 / 8.99
JHF-S1	12.79	11.79	8.93	7.94	7.22	6.76	6.43	6.01	5.72	5.07 / 9.89
JHF-S2	12.77	11.76	8.88	7.91	7.21	6.76	6.43	6.02	5.73	5.07 / 9.93
JHF-S3	12.81	11.81	8.92	7.92	7.22	6.77	6.44	6.02	5.73	5.08 / 9.97
JHF-S4	12.64	11.59	8.74	7.84	7.19	6.78	6.48	6.10	5.82	5.19 / 9.58
JHF-S5	12.34	11.26	8.61	7.75	7.15	6.75	6.48	6.10	5.83	5.23 / 9.45
JHF-S6	12.37	11.31	8.63	7.75	7.15	6.76	6.48	6.10	5.83	5.24 / 9.45
JHF-S7	12.39	11.31	8.62	7.77	7.16	6.77	6.50	6.11	5.84	5.23 / 9.47
JHF-S8	11.58	10.55	8.18	7.42	6.95	6.62	6.39	6.05	5.79	5.35 / 8.68
GHLC-S1	12.70	11.82	8.93	7.84	7.08	6.52	6.15	5.69	5.38	4.87 / 8.75
GHLC-S2	12.65	11.82	8.86	7.83	7.07	6.52	6.15	5.69	5.38	4.85 / 8.82
GHLC-S3	12.70	11.83	8.89	7.84	7.08	6.54	6.18	5.71	5.41	4.90 / 8.92
GHLC-S4	12.70	11.90	8.94	7.90	7.13	6.63	6.26	5.81	5.50	4.95 / 9.60
GHLC-S5	12.75	11.86	8.95	7.92	7.14	6.64	6.28	5.83	5.52	4.94 / 9.60
GHLC-S6	12.68	11.76	8.91	7.89	7.15	6.66	6.31	5.87	5.57	4.98 / 9.89
GHLC-S7	12.63	11.73	8.88	7.88	7.13	6.66	6.31	5.86	5.56	5.01 / 9.89
GHLC-S8	12.66	11.73	8.89	7.84	7.14	6.65	6.31	5.87	5.56	4.98 / 9.93
GHLC-S9	12.64	11.72	8.88	7.84	7.12	6.65	6.30	5.86	5.56	4.98 / 9.95
GHLC-S10	12.55	11.64	8.82	7.84	7.11	6.64	6.28	5.84	5.53	4.99 / 9.99

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。