

P S J 予測統計値
(中央値)

2008年 9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,BNPP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	13.34	12.82	10.24	9.31	8.77	8.04	7.62	7.22	7.10	7.47 /	9.61
JHF-2	13.38	12.79	10.14	9.18	8.76	7.98	7.62	7.21	7.11	7.49 /	9.60
JHF-3	13.42	12.94	10.27	9.13	8.78	8.07	7.60	7.22	7.12	7.53 /	9.64
JHF-4	13.71	13.09	10.33	9.22	8.81	8.12	7.63	7.27	7.14	7.55 /	9.73
JHF-5	13.96	13.46	10.36	9.18	8.86	8.22	7.68	7.30	7.14	7.59 /	9.76
JHF-6	13.83	13.22	10.19	9.02	8.70	8.22	7.66	7.26	7.17	7.56 /	9.75
JHF-7	13.11	12.69	9.88	9.08	8.73	8.06	7.61	7.29	7.18	7.49 /	9.58
JHF-8	13.75	13.21	10.06	8.95	8.55	8.08	7.65	7.25	7.10	7.57 /	9.69
JHF-9	13.07	12.85	9.52	8.92	8.54	8.16	7.64	7.26	7.14	7.53 /	9.64
JHF-10	12.78	12.41	9.63	9.05	8.68	7.93	7.57	7.28	7.22	7.49 /	9.57
JHF-11	13.35	12.88	9.90	9.14	8.80	8.09	7.62	7.35	7.23	7.55 /	9.69
JHF-12	13.29	12.80	9.85	9.17	8.69	8.11	7.59	7.36	7.25	7.57 /	9.75
JHF-13	13.25	12.73	10.01	9.15	8.71	8.10	7.74	7.40	7.26	7.57 /	10.29
JHF-14	12.92	12.60	9.65	9.11	8.54	7.98	7.58	7.39	7.29	7.58 /	10.03
JHF-15	14.27	13.71	10.41	9.31	8.83	8.32	7.75	7.50	7.34	7.75 /	10.20
JHF-16	14.95	14.41	10.62	9.55	9.05	8.43	7.90	7.54	7.36	7.83 /	10.48
JHF-17	14.45	13.90	10.49	9.38	8.98	8.40	7.84	7.50	7.37	7.80 /	10.13
GHLC-1	12.90	12.47	9.83	8.51	7.62	6.81	6.24	5.62	5.24	5.41 /	8.95
GHLC-2	12.91	12.58	9.87	8.53	7.65	6.85	6.32	5.70	5.28	5.46 /	8.82
GHLC-3	12.94	12.70	10.33	8.72	7.69	6.91	6.19	5.73	5.36	5.48 /	8.67
GHLC-4	12.92	12.18	9.50	8.28	7.51	6.81	6.35	5.71	5.38	5.32 /	8.86
GHLC-5	12.86	12.17	9.78	8.63	7.63	6.86	6.47	5.93	5.38	5.38 /	8.91
GHLC-6	12.98	12.06	10.07	8.76	7.77	6.95	6.53	5.96	5.42	5.43 /	8.73
GHLC-7	12.70	12.26	10.41	8.77	7.73	7.00	6.65	5.93	5.42	5.41 /	8.84
GHLC-8	12.52	12.06	10.13	8.79	7.81	7.01	6.62	5.98	5.45	5.47 /	8.64
GHLC-9	12.67	12.10	9.76	8.44	7.63	6.94	6.54	5.96	5.46	5.44 /	8.53
GHLC-10	12.34	12.14	10.04	8.69	7.75	6.94	6.67	5.92	5.47	5.44 /	8.40
GHLC-11	12.35	12.00	9.76	8.48	7.54	6.90	6.62	5.87	5.48	5.41 /	8.46
GHLC-12	12.13	11.97	9.98	8.53	7.59	7.07	6.53	5.81	5.49	5.41 /	8.53
GHLC-13	12.16	12.14	10.01	8.56	7.79	7.09	6.56	5.82	5.49	5.46 /	8.83
GHLC-14	12.25	12.13	9.82	8.64	7.68	7.04	6.61	5.85	5.50	5.46 /	8.30
GHLC-15	12.29	12.13	9.98	8.56	7.65	7.04	6.59	5.87	5.50	5.43 /	8.34
GHLC-16	12.16	12.08	10.01	8.63	7.68	7.10	6.55	5.86	5.49	5.46 /	8.55
GHLC-17	12.15	12.09	9.60	8.63	7.67	7.11	6.57	5.88	5.53	5.48 /	8.31
GHLC-18	12.20	11.97	9.89	8.54	7.75	7.08	6.55	5.87	5.53	5.50 /	8.47
GHLC-19	12.06	11.92	9.82	8.52	7.70	7.07	6.54	5.90	5.53	5.52 /	8.46
GHLC-20	12.05	11.84	9.42	8.51	7.57	7.06	6.49	5.93	5.57	5.57 /	8.24
GHLC-21	12.08	11.77	9.73	8.58	7.72	7.07	6.46	5.91	5.59	5.61 /	8.53
GHLC-22	12.28	12.02	9.66	8.55	7.64	6.98	6.51	5.93	5.58	5.66 /	8.10
GHLC-23	12.35	12.03	9.54	8.53	7.65	7.03	6.51	5.93	5.59	5.67 /	8.09
GHLC-24	12.34	11.95	9.43	8.54	7.60	7.02	6.50	5.93	5.61	5.71 /	8.06
GHLC-25	12.23	11.83	9.44	8.41	7.61	7.01	6.54	5.90	5.63	5.69 /	8.01
GHLC-26	11.99	11.40	9.37	8.29	7.50	6.91	6.42	5.82	5.58	5.57 /	8.31
GHLC-27	11.50	10.64	8.96	8.15	7.44	6.76	6.49	5.86	5.71	5.65 /	8.08
GHLC-28	12.00	11.56	9.19	8.21	7.51	6.88	6.48	5.84	5.62	5.62 /	7.92
GHLC-29	11.23	10.51	8.99	8.09	7.48	6.73	6.49	5.86	5.72	5.68 /	8.56
GHLC-30	11.03	10.09	8.90	8.00	7.42	6.73	6.48	5.91	5.78	5.72 /	9.35
GHLC-31	11.09	10.33	8.76	7.88	7.40	6.74	6.41	5.85	5.74	5.65 /	8.71
GHLC-32	10.52	10.07	8.64	7.88	7.26	6.71	6.38	5.86	5.75	5.66 /	8.10
GHLC-33	11.07	10.57	8.83	7.98	7.34	6.73	6.44	5.88	5.76	5.70 /	8.32
GHLC-34	10.76	10.04	8.59	7.81	7.22	6.70	6.37	5.87	5.76	5.65 /	8.20

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-35	10.78	10.39	8.64	7.90	7.27	6.71	6.39	5.88	5.76	5.67 / 8.08
GHLC-36	11.44	10.60	8.91	8.07	7.41	6.78	6.47	5.92	5.79	5.72 / 8.47
GHLC-37	11.49	10.34	8.83	7.98	7.41	6.77	6.45	5.91	5.80	5.71 / 8.38
GHLC-38	11.46	10.96	8.91	8.06	7.50	6.80	6.51	5.91	5.79	5.76 / 7.98
GHLC-39	11.47	10.64	8.86	8.07	7.48	6.87	6.46	5.94	5.82	5.75 / 8.71
GHLC-40	11.81	10.89	9.19	8.25	7.61	6.97	6.57	5.96	5.81	5.79 / 8.39
GHLC-41	11.49	10.59	8.83	8.06	7.49	6.81	6.42	5.95	5.82	5.75 / 8.68
GHLC-42	11.94	11.27	9.10	8.22	7.61	7.00	6.56	6.01	5.86	5.82 / 9.11
GHLC-43	11.95	11.35	9.23	8.29	7.71	7.05	6.57	6.02	5.84	5.90 / 8.14
GHLC-44	12.73	12.36	9.61	8.58	7.91	7.18	6.65	6.10	5.88	6.03 / 8.55
GHLC-45	12.31	12.00	9.55	8.49	7.80	7.20	6.62	6.10	5.90	5.97 / 8.52
GHLC-46	12.36	12.11	9.50	8.48	7.82	7.19	6.65	6.10	5.89	6.00 / 8.56
GHLC-47	12.63	12.20	9.43	8.39	7.82	7.22	6.62	6.12	5.91	6.00 / 8.62
GHLC-48	12.18	11.33	9.13	8.22	7.60	7.12	6.59	6.05	5.90	5.88 / 8.41
GHLC-49	12.17	11.49	8.96	8.23	7.56	7.13	6.50	6.03	5.89	5.87 / 8.22
GHLC-50	12.68	12.18	9.45	8.47	7.80	7.27	6.76	6.16	5.95	6.01 / 8.68
GHLC-51	12.15	11.71	9.08	8.26	7.63	7.15	6.57	6.07	5.92	5.93 / 8.37
GHLC-52	11.99	11.52	9.02	8.17	7.54	7.09	6.58	6.06	5.92	5.88 / 8.42
GHLC-53	12.30	11.60	9.12	8.27	7.60	7.13	6.65	6.10	5.95	5.93 / 8.81
JHF-S1	12.15	11.68	10.11	8.69	7.68	6.93	6.39	6.07	5.50	5.31 / 8.53
JHF-S2	12.17	11.53	10.05	8.83	7.67	6.89	6.41	6.08	5.50	5.30 / 8.53
JHF-S3	12.06	11.53	10.16	8.75	7.70	6.91	6.40	6.09	5.52	5.32 / 8.50
JHF-S4	12.04	11.71	9.85	8.42	7.68	6.85	6.57	6.03	5.56	5.33 / 8.34
JHF-S5	11.80	11.66	9.69	8.34	7.50	6.79	6.56	5.95	5.57	5.32 / 8.34
JHF-S6	11.84	11.75	9.77	8.61	7.51	6.80	6.56	5.96	5.58	5.33 / 8.33
JHF-S7	11.91	11.82	9.84	8.58	7.48	6.81	6.56	5.97	5.57	5.33 / 8.53
JHF-S8	11.33	10.91	9.04	8.17	7.12	6.69	6.36	5.81	5.60	5.34 / 8.27
JHF-S9	11.33	10.94	9.02	7.98	7.12	6.70	6.37	5.82	5.60	5.34 / 8.31
JHF-S10	11.02	10.71	8.90	7.96	7.44	6.84	6.38	5.82	5.63	5.44 / 9.19
GHLC-S1	12.40	12.10	9.83	8.36	7.43	6.82	6.27	5.83	5.26	5.35 / 8.92
GHLC-S2	12.46	12.09	9.84	8.37	7.43	6.79	6.30	5.86	5.27	5.33 / 8.89
GHLC-S3	12.48	11.91	9.95	8.40	7.45	6.71	6.30	5.91	5.28	5.38 / 8.83
GHLC-S4	12.48	11.92	9.97	8.42	7.46	6.86	6.35	5.93	5.36	5.33 / 8.80
GHLC-S5	12.43	12.24	10.22	8.67	7.45	6.84	6.49	5.94	5.36	5.32 / 8.73
GHLC-S6	12.54	11.60	9.87	8.39	7.44	6.95	6.37	5.98	5.40	5.31 / 8.58
GHLC-S7	12.47	11.91	9.82	8.38	7.45	6.92	6.33	5.98	5.40	5.32 / 8.55
GHLC-S8	12.52	11.78	9.86	8.36	7.44	6.93	6.33	5.99	5.39	5.31 / 8.55
GHLC-S9	12.47	11.94	9.86	8.38	7.43	6.90	6.35	5.99	5.40	5.31 / 8.55
GHLC-S10	12.20	11.81	9.76	8.39	7.44	6.90	6.32	5.99	5.41	5.28 / 8.55

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。