

PSJ 予測統計値
(中央値)

2007年 10月 15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,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	13.78	13.23	10.17	9.30	8.89	8.19	7.86	7.39	7.20	7.68 / 10.17		
JHF-2	14.03	13.09	10.15	9.29	8.90	8.19	7.87	7.40	7.20	7.69 / 10.17		
JHF-3	13.86	13.40	10.21	9.35	8.96	8.19	7.78	7.37	7.20	7.73 / 10.19		
JHF-4	14.34	13.58	10.29	9.43	9.00	8.29	7.86	7.42	7.25	7.76 / 10.26		
JHF-5	14.65	13.95	10.43	9.55	9.06	8.32	7.84	7.36	7.23	7.79 / 10.33		
JHF-6	14.30	13.80	10.31	9.42	8.95	8.30	7.80	7.31	7.20	7.59 / 10.34		
GHLC-1	13.03	12.73	10.22	8.94	7.84	7.10	6.61	5.92	5.33	5.38 / 8.81		
GHLC-2	13.05	12.52	10.17	8.84	7.81	7.14	6.51	5.92	5.39	5.48 / 8.96		
GHLC-3	13.14	12.82	10.32	8.78	7.87	7.14	6.52	5.94	5.41	5.50 / 9.00		
GHLC-4	13.02	12.34	9.41	8.55	7.55	7.01	6.49	5.85	5.45	5.68 / 9.05		
GHLC-5	12.94	12.25	9.21	8.47	7.52	6.94	6.51	5.82	5.50	5.80 / 8.97		
GHLC-6	13.01	12.37	9.30	8.58	7.59	6.98	6.54	5.83	5.56	5.94 / 8.94		
GHLC-7	12.98	12.42	9.55	8.38	7.52	7.02	6.58	5.84	5.53	5.96 / 8.98		
GHLC-8	13.03	12.25	9.45	8.53	7.58	6.97	6.59	5.87	5.57	6.02 / 8.89		
GHLC-9	12.82	12.18	9.32	8.32	7.56	6.95	6.51	5.84	5.60	6.03 / 8.83		
GHLC-10	12.66	12.26	9.38	8.39	7.53	6.92	6.50	5.82	5.60	6.11 / 8.78		
GHLC-11	12.34	11.91	9.18	8.34	7.46	6.89	6.43	5.86	5.64	6.13 / 8.68		
GHLC-12	11.98	11.77	9.16	8.08	7.41	6.92	6.36	5.85	5.66	6.25 / 8.66		
GHLC-13	12.23	12.03	9.12	8.30	7.54	6.85	6.39	5.86	5.67	6.30 / 8.85		
GHLC-14	12.23	12.11	9.31	8.15	7.44	6.86	6.43	5.87	5.66	6.22 / 8.40		
GHLC-15	12.17	12.03	9.25	8.14	7.42	6.87	6.40	5.87	5.66	6.25 / 8.42		
GHLC-16	12.22	11.99	9.12	8.14	7.41	6.93	6.38	5.86	5.67	6.27 / 8.70		
GHLC-17	12.10	11.92	9.06	8.13	7.39	6.89	6.39	5.88	5.67	6.30 / 8.39		
GHLC-18	11.94	11.62	9.00	8.19	7.41	6.84	6.38	5.88	5.68	6.27 / 8.53		
GHLC-19	11.94	11.60	8.99	8.09	7.43	6.85	6.37	5.89	5.71	6.32 / 8.55		
GHLC-20	12.13	11.84	9.13	8.16	7.36	6.89	6.36	5.90	5.74	6.37 / 8.45		
GHLC-21	12.43	11.72	9.18	8.18	7.48	6.89	6.38	5.95	5.82	6.46 / 8.71		
GHLC-22	12.50	11.92	9.19	8.18	7.38	6.87	6.42	5.93	5.81	6.50 / 8.43		
GHLC-23	12.60	11.95	9.23	8.16	7.38	6.88	6.44	5.95	5.84	6.50 / 8.52		
GHLC-24	12.55	11.79	9.12	8.11	7.35	6.89	6.45	6.00	5.88	6.56 / 8.75		
GHLC-25	12.25	11.65	9.02	7.98	7.26	6.83	6.47	6.02	5.90	6.58 / 8.85		
GHLC-26	11.79	11.42	8.84	7.84	7.27	6.79	6.37	5.93	5.82	6.47 / 8.48		
GHLC-27	11.60	10.73	8.59	7.76	7.18	6.67	6.37	6.08	5.96	6.51 / 8.84		
GHLC-28	11.86	11.42	8.82	7.79	7.16	6.76	6.40	6.02	5.89	6.52 / 9.04		
GHLC-29	11.32	10.78	8.51	7.80	7.23	6.71	6.37	6.09	5.97	6.48 / 8.69		
GHLC-30	11.19	10.46	8.41	7.73	7.20	6.68	6.43	6.15	6.02	6.43 / 9.46		
GHLC-31	11.17	10.50	8.32	7.66	7.11	6.64	6.33	6.10	5.98	6.32 / 8.86		
GHLC-32	10.70	10.17	8.24	7.49	6.97	6.65	6.29	6.10	5.98	6.25 / 8.67		
GHLC-33	11.39	10.74	8.38	7.59	7.10	6.74	6.35	6.12	6.00	6.38 / 8.81		
GHLC-34	10.75	10.31	8.19	7.45	6.97	6.68	6.31	6.12	6.00	6.25 / 8.50		
GHLC-35	10.77	10.36	8.07	7.34	6.92	6.68	6.32	6.11	6.00	6.25 / 8.41		
GHLC-36	11.92	10.52	8.48	7.69	7.17	6.78	6.41	6.15	6.02	6.39 / 8.64		
GHLC-37	11.33	10.74	8.35	7.53	7.07	6.76	6.40	6.15	6.03	6.35 / 8.54		
GHLC-38	11.57	10.77	8.47	7.58	7.11	6.74	6.43	6.16	6.04	6.46 / 8.51		
GHLC-39	12.04	10.73	8.49	7.66	7.19	6.82	6.45	6.19	6.06	6.40 / 8.89		
GHLC-40	12.22	11.09	8.78	7.85	7.24	6.88	6.50	6.18	6.05	6.57 / 8.68		
GHLC-41	11.46	10.75	8.43	7.55	7.10	6.75	6.42	6.19	6.05	6.39 / 8.86		
GHLC-42	12.30	11.10	8.76	7.89	7.29	6.86	6.55	6.24	6.11	6.55 / 9.30		
GHLC-43	12.35	11.88	8.87	7.89	7.24	6.91	6.56	6.23	6.09	6.67 / 9.03		
GHLC-44	13.14	12.59	9.29	8.22	7.38	7.01	6.61	6.27	6.13	6.82 / 9.09		
GHLC-45	12.71	12.27	9.16	8.14	7.35	6.97	6.62	6.28	6.14	6.71 / 8.95		

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・ブザース、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-46	12.80	12.20	9.18	8.15	7.37	6.97	6.64	6.29	6.14	6.75 /	9.02	
GHLC-47	12.85	12.25	9.10	8.15	7.41	6.99	6.65	6.29	6.14	6.73 /	9.40	
GHLC-48	12.25	11.53	8.75	7.91	7.26	6.91	6.60	6.28	6.13	6.55 /	9.38	
GHLC-49	12.34	11.63	8.73	7.91	7.26	6.92	6.54	6.27	6.12	6.56 /	9.47	
GHLC-50	12.91	12.27	9.22	8.13	7.42	7.01	6.73	6.34	6.19	6.72 /	9.53	
GHLC-51	12.60	12.01	8.80	7.95	7.33	6.97	6.60	6.30	6.15	6.62 /	9.68	
GHLC-52	12.54	11.73	8.71	7.83	7.24	6.92	6.60	6.31	6.16	6.54 /	9.55	
GHLC-53	12.51	11.78	8.88	7.91	7.32	6.98	6.65	6.34	6.19	6.61 /	9.11	
JHF-S1	12.66	11.85	9.89	8.72	7.54	6.82	6.54	5.87	5.62	5.81 /	9.73	
JHF-S2	12.66	11.85	9.67	8.73	7.50	6.82	6.53	5.86	5.61	5.81 /	9.76	
JHF-S3	12.63	11.88	9.72	8.71	7.53	6.81	6.54	5.89	5.62	5.82 /	9.78	
GHLC-S1	12.70	12.27	10.22	8.89	7.80	7.04	6.45	5.93	5.38	5.47 /	8.96	
GHLC-S2	12.72	11.99	10.24	8.92	7.75	7.03	6.45	5.95	5.39	5.52 /	9.04	
GHLC-S3	12.69	12.21	10.25	8.91	7.76	7.01	6.48	5.96	5.42	5.52 /	9.10	
GHLC-S4	12.66	12.15	10.09	8.76	7.85	7.08	6.53	5.94	5.47	5.59 /	9.49	
GHLC-S5	12.79	12.45	10.12	8.82	7.84	7.06	6.66	5.94	5.47	5.57 /	9.52	
GHLC-S6	12.67	11.86	9.93	8.59	7.84	6.90	6.50	5.90	5.56	5.71 /	9.77	
GHLC-S7	12.64	11.93	9.96	8.80	7.80	6.90	6.50	5.90	5.56	5.70 /	9.77	
GHLC-S8	12.62	11.89	9.96	8.68	7.76	6.86	6.50	5.89	5.55	5.70 /	9.79	
GHLC-S9	12.58	11.84	9.97	8.83	7.73	6.85	6.49	5.89	5.55	5.68 /	9.83	
GHLC-S10	12.57	11.85	9.96	8.70	7.69	6.84	6.49	5.90	5.54	5.68 /	9.84	

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。