

P S J 予測統計値  
(平均値)

2007年 11月 1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	16.00	14.86	10.98	9.77	8.94	8.47	8.09	7.54	7.20	7.78 / 10.22	
JHF-2	15.99	14.83	11.00	9.79	8.93	8.46	8.08	7.53	7.19	7.79 / 10.23	
JHF-3	16.21	15.02	11.03	9.78	8.94	8.49	8.10	7.56	7.21	7.85 / 10.25	
JHF-4	16.56	15.39	11.25	9.91	9.04	8.56	8.18	7.61	7.25	7.87 / 10.30	
JHF-5	16.99	15.85	11.35	9.96	9.04	8.54	8.17	7.57	7.22	7.90 / 10.38	
JHF-6	16.80	15.53	11.17	9.86	8.99	8.49	8.13	7.55	7.20	7.72 / 10.38	
JHF-7	15.95	14.63	10.84	9.73	8.92	8.48	8.10	7.55	7.21	7.64 / 10.22	
GHLC-1	13.85	13.33	10.54	8.93	7.75	7.00	6.53	5.94	5.58	5.44 / 9.35	
GHLC-2	13.81	13.27	10.47	8.90	7.72	6.98	6.51	5.95	5.58	5.49 / 9.20	
GHLC-3	13.98	13.43	10.52	8.94	7.77	7.02	6.55	5.98	5.63	5.54 / 9.18	
GHLC-4	13.30	12.76	9.93	8.50	7.54	6.95	6.54	6.02	5.67	5.66 / 9.06	
GHLC-5	13.17	12.63	9.77	8.42	7.51	6.94	6.54	6.03	5.68	5.78 / 8.95	
GHLC-6	13.34	12.77	9.88	8.50	7.58	7.00	6.60	6.08	5.73	5.88 / 8.94	
GHLC-7	13.48	12.89	9.92	8.61	7.64	7.05	6.64	6.12	5.77	5.93 / 8.97	
GHLC-8	13.50	12.91	9.91	8.54	7.62	7.05	6.64	6.12	5.76	6.00 / 8.87	
GHLC-9	13.13	12.51	9.70	8.38	7.51	6.97	6.57	6.06	5.72	6.03 / 8.84	
GHLC-10	12.96	12.34	9.62	8.35	7.51	6.99	6.60	6.11	5.76	6.09 / 8.80	
GHLC-11	12.80	12.20	9.44	8.20	7.43	6.93	6.55	6.07	5.73	6.12 / 8.72	
GHLC-12	12.65	11.99	9.24	8.11	7.39	6.92	6.57	6.10	5.77	6.22 / 8.64	
GHLC-13	12.81	12.15	9.32	8.21	7.45	6.97	6.60	6.13	5.80	6.28 / 8.84	
GHLC-14	12.87	12.16	9.35	8.20	7.42	6.93	6.56	6.08	5.75	6.19 / 8.48	
GHLC-15	12.84	12.19	9.30	8.15	7.42	6.93	6.57	6.09	5.77	6.23 / 8.50	
GHLC-16	12.77	12.12	9.25	8.16	7.42	6.95	6.59	6.12	5.79	6.25 / 8.68	
GHLC-17	12.76	12.07	9.27	8.17	7.41	6.94	6.58	6.11	5.79	6.28 / 8.47	
GHLC-18	12.71	12.02	9.18	8.14	7.39	6.93	6.58	6.11	5.79	6.25 / 8.51	
GHLC-19	12.69	11.97	9.21	8.09	7.40	6.94	6.59	6.13	5.81	6.31 / 8.53	
GHLC-20	12.94	12.23	9.36	8.22	7.44	6.95	6.60	6.13	5.80	6.36 / 8.63	
GHLC-21	12.97	12.25	9.38	8.29	7.48	7.01	6.66	6.19	5.86	6.44 / 8.69	
GHLC-22	13.09	12.40	9.43	8.27	7.47	6.98	6.63	6.15	5.82	6.49 / 8.49	
GHLC-23	13.17	12.45	9.44	8.28	7.48	7.00	6.64	6.16	5.84	6.52 / 8.59	
GHLC-24	13.23	12.52	9.46	8.32	7.50	7.00	6.65	6.16	5.84	6.55 / 8.93	
GHLC-25	13.12	12.30	9.37	8.25	7.45	6.98	6.63	6.14	5.82	6.58 / 9.04	
GHLC-26	12.57	11.84	9.10	8.08	7.35	6.91	6.58	6.14	5.82	6.48 / 8.56	
GHLC-27	12.45	11.60	8.98	8.03	7.33	6.91	6.58	6.14	5.83	6.58 / 9.02	
GHLC-28	12.79	11.97	9.19	8.19	7.40	6.92	6.59	6.13	5.81	6.56 / 9.30	
GHLC-29	12.33	11.48	8.95	8.03	7.34	6.94	6.61	6.17	5.87	6.56 / 8.78	
GHLC-30	12.27	11.39	8.99	8.08	7.41	7.02	6.69	6.25	5.96	6.51 / 9.46	
GHLC-31	12.01	11.15	8.83	7.88	7.29	6.91	6.59	6.17	5.88	6.40 / 8.85	
GHLC-32	11.67	10.82	8.59	7.75	7.20	6.83	6.52	6.11	5.82	6.34 / 8.85	
GHLC-33	12.16	11.31	8.84	7.95	7.29	6.90	6.58	6.15	5.86	6.44 / 9.00	
GHLC-34	11.75	10.86	8.59	7.80	7.20	6.84	6.53	6.12	5.84	6.31 / 8.69	
GHLC-35	11.86	10.95	8.64	7.75	7.20	6.85	6.54	6.11	5.83	6.33 / 8.58	
GHLC-36	12.40	11.47	8.94	7.94	7.33	6.95	6.62	6.18	5.88	6.48 / 8.63	
GHLC-37	12.22	11.33	8.84	7.87	7.28	6.91	6.59	6.16	5.86	6.42 / 8.54	
GHLC-38	12.64	11.77	9.00	7.97	7.32	6.94	6.61	6.15	5.86	6.52 / 8.60	
GHLC-39	12.57	11.67	8.96	8.01	7.37	6.98	6.65	6.20	5.90	6.46 / 8.88	
GHLC-40	13.14	12.24	9.24	8.13	7.45	7.03	6.70	6.23	5.92	6.65 / 8.67	
GHLC-41	12.73	11.76	9.03	8.03	7.37	6.98	6.64	6.19	5.88	6.47 / 8.93	
GHLC-42	13.41	12.48	9.38	8.33	7.54	7.10	6.76	6.28	5.97	6.63 / 9.29	
GHLC-43	13.86	12.93	9.52	8.35	7.54	7.07	6.73	6.23	5.92	6.72 / 9.22	
GHLC-44	14.72	13.80	10.06	8.67	7.70	7.18	6.84	6.29	5.95	6.90 / 9.28	

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-45	14.43	13.45	9.82	8.51	7.66	7.16	6.83	6.29	5.97	6.77 / 9.14
GHLC-46	14.60	13.63	9.92	8.59	7.68	7.17	6.83	6.29	5.95	6.80 / 9.25
GHLC-47	14.74	13.72	10.01	8.62	7.70	7.18	6.82	6.28	5.94	6.79 / 9.55
GHLC-48	13.86	12.81	9.57	8.33	7.58	7.10	6.75	6.24	5.92	6.60 / 9.54
GHLC-49	13.92	12.85	9.58	8.33	7.55	7.07	6.72	6.22	5.89	6.61 / 9.63
GHLC-50	14.87	13.83	10.11	8.71	7.77	7.24	6.87	6.32	5.98	6.76 / 9.69
GHLC-51	14.36	13.30	9.77	8.48	7.64	7.14	6.78	6.25	5.92	6.66 / 9.80
GHLC-52	14.05	12.94	9.59	8.39	7.61	7.12	6.76	6.26	5.94	6.58 / 9.71
GHLC-53	14.36	13.26	9.69	8.47	7.66	7.19	6.84	6.33	6.00	6.67 / 9.11
JHF-S1	13.28	12.73	9.90	8.60	7.63	7.05	6.63	6.13	5.78	5.79 / 9.76
JHF-S2	13.33	12.69	9.89	8.57	7.63	7.05	6.63	6.13	5.78	5.80 / 9.78
JHF-S3	13.30	12.71	9.88	8.58	7.63	7.06	6.64	6.13	5.79	5.80 / 9.82
JHF-S4	13.09	12.45	9.62	8.44	7.52	6.99	6.60	6.11	5.78	5.99 / 9.56
GHLC-S1	13.54	13.00	10.31	8.78	7.67	6.93	6.47	5.91	5.54	5.49 / 9.18
GHLC-S2	13.52	12.99	10.32	8.75	7.67	6.94	6.48	5.92	5.55	5.52 / 9.24
GHLC-S3	13.51	13.01	10.29	8.78	7.67	6.95	6.49	5.93	5.57	5.56 / 9.28
GHLC-S4	13.45	12.91	10.16	8.70	7.67	7.04	6.61	6.06	5.71	5.61 / 9.46
GHLC-S5	13.48	12.91	10.15	8.71	7.67	7.05	6.61	6.07	5.71	5.58 / 9.46
GHLC-S6	13.35	12.81	10.03	8.64	7.65	7.05	6.62	6.08	5.74	5.68 / 9.71
GHLC-S7	13.35	12.78	10.02	8.60	7.64	7.05	6.62	6.09	5.74	5.69 / 9.72
GHLC-S8	13.34	12.78	10.00	8.62	7.64	7.05	6.62	6.08	5.74	5.68 / 9.77
GHLC-S9	13.35	12.72	9.97	8.58	7.62	7.03	6.61	6.07	5.73	5.69 / 9.78
GHLC-S10	13.27	12.75	10.00	8.59	7.62	7.03	6.61	6.08	5.73	5.68 / 9.81

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。