

P S J 予測統計値
(平均値)

2008年 6月 2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 | 14.55 | 13.46 | 9.90 | 9.07 | 8.53 | 8.13 | 7.87 | 7.46 | 7.17 | 7.44 / 9.98 | |
| JHF-2 | 14.50 | 13.34 | 9.85 | 8.97 | 8.47 | 8.09 | 7.83 | 7.42 | 7.13 | 7.45 / 9.97 | |
| JHF-3 | 14.68 | 13.55 | 9.93 | 9.03 | 8.46 | 8.11 | 7.84 | 7.45 | 7.15 | 7.49 / 9.98 | |
| JHF-4 | 14.93 | 13.79 | 10.05 | 9.10 | 8.52 | 8.17 | 7.89 | 7.48 | 7.19 | 7.52 / 10.01 | |
| JHF-5 | 15.34 | 14.17 | 10.17 | 9.15 | 8.54 | 8.15 | 7.86 | 7.45 | 7.15 | 7.55 / 10.09 | |
| JHF-6 | 15.20 | 13.94 | 10.03 | 9.09 | 8.50 | 8.11 | 7.83 | 7.43 | 7.13 | 7.47 / 10.08 | |
| JHF-7 | 14.42 | 13.10 | 9.70 | 8.93 | 8.45 | 8.11 | 7.85 | 7.46 | 7.16 | 7.50 / 10.00 | |
| JHF-8 | 15.09 | 13.83 | 9.99 | 9.04 | 8.47 | 8.10 | 7.83 | 7.43 | 7.13 | 7.42 / 10.10 | |
| JHF-9 | 14.65 | 13.36 | 9.75 | 8.95 | 8.41 | 8.09 | 7.83 | 7.43 | 7.13 | 7.39 / 10.04 | |
| JHF-10 | 14.11 | 12.77 | 9.61 | 8.88 | 8.40 | 8.10 | 7.86 | 7.47 | 7.18 | 7.47 / 9.99 | |
| JHF-11 | 14.86 | 13.55 | 9.85 | 9.04 | 8.51 | 8.19 | 7.93 | 7.54 | 7.24 | 7.47 / 10.06 | |
| JHF-12 | 14.84 | 13.42 | 9.86 | 8.98 | 8.55 | 8.22 | 7.97 | 7.57 | 7.28 | 7.36 / 10.07 | |
| JHF-13 | 14.80 | 13.36 | 9.88 | 9.07 | 8.60 | 8.28 | 8.03 | 7.64 | 7.34 | 7.32 / 10.44 | |
| JHF-14 | 14.43 | 12.96 | 9.70 | 8.94 | 8.51 | 8.20 | 7.96 | 7.57 | 7.28 | 7.40 / 10.02 | |
| GHLC-1 | 13.05 | 12.46 | 9.44 | 8.08 | 7.16 | 6.55 | 6.15 | 5.69 | 5.37 | 4.74 / 8.79 | |
| GHLC-2 | 13.07 | 12.47 | 9.45 | 8.13 | 7.19 | 6.58 | 6.18 | 5.72 | 5.41 | 4.79 / 8.95 | |
| GHLC-3 | 13.25 | 12.63 | 9.47 | 8.17 | 7.25 | 6.64 | 6.23 | 5.77 | 5.47 | 4.83 / 9.17 | |
| GHLC-4 | 12.80 | 12.19 | 9.13 | 7.93 | 7.16 | 6.64 | 6.28 | 5.83 | 5.52 | 4.79 / 9.23 | |
| GHLC-5 | 12.80 | 12.16 | 9.12 | 7.96 | 7.20 | 6.70 | 6.35 | 5.92 | 5.61 | 4.90 / 8.96 | |
| GHLC-6 | 13.00 | 12.30 | 9.21 | 8.08 | 7.32 | 6.79 | 6.43 | 5.99 | 5.69 | 4.97 / 8.98 | |
| GHLC-7 | 13.04 | 12.43 | 9.25 | 8.13 | 7.36 | 6.85 | 6.50 | 6.06 | 5.77 | 5.00 / 9.18 | |
| GHLC-8 | 13.09 | 12.45 | 9.28 | 8.19 | 7.36 | 6.85 | 6.50 | 6.07 | 5.77 | 5.07 / 8.84 | |
| GHLC-9 | 12.78 | 12.12 | 9.09 | 7.99 | 7.26 | 6.77 | 6.44 | 6.03 | 5.73 | 5.08 / 8.81 | |
| GHLC-10 | 12.74 | 12.02 | 9.02 | 8.04 | 7.31 | 6.82 | 6.51 | 6.08 | 5.78 | 5.09 / 8.76 | |
| GHLC-11 | 12.60 | 11.89 | 8.91 | 7.94 | 7.29 | 6.81 | 6.49 | 6.06 | 5.76 | 5.10 / 8.91 | |
| GHLC-12 | 12.53 | 11.75 | 8.82 | 7.89 | 7.24 | 6.81 | 6.51 | 6.10 | 5.81 | 5.18 / 8.80 | |
| GHLC-13 | 12.71 | 11.96 | 8.96 | 7.98 | 7.31 | 6.85 | 6.55 | 6.13 | 5.84 | 5.23 / 9.02 | |
| GHLC-14 | 12.78 | 11.97 | 8.89 | 7.98 | 7.26 | 6.81 | 6.50 | 6.07 | 5.78 | 5.18 / 8.44 | |
| GHLC-15 | 12.74 | 11.94 | 8.90 | 7.94 | 7.25 | 6.81 | 6.50 | 6.08 | 5.79 | 5.20 / 8.52 | |
| GHLC-16 | 12.66 | 11.87 | 8.86 | 7.96 | 7.26 | 6.83 | 6.53 | 6.11 | 5.82 | 5.20 / 8.80 | |
| GHLC-17 | 12.66 | 11.89 | 8.88 | 7.93 | 7.25 | 6.83 | 6.52 | 6.11 | 5.82 | 5.24 / 8.57 | |
| GHLC-18 | 12.60 | 11.85 | 8.85 | 7.94 | 7.25 | 6.81 | 6.53 | 6.12 | 5.83 | 5.27 / 8.70 | |
| GHLC-19 | 12.59 | 11.81 | 8.84 | 7.92 | 7.23 | 6.81 | 6.53 | 6.12 | 5.84 | 5.29 / 8.59 | |
| GHLC-20 | 12.53 | 11.69 | 8.79 | 7.83 | 7.19 | 6.79 | 6.51 | 6.11 | 5.83 | 5.34 / 8.33 | |
| GHLC-21 | 12.55 | 11.71 | 8.80 | 7.88 | 7.24 | 6.85 | 6.57 | 6.17 | 5.89 | 5.39 / 8.69 | |
| GHLC-22 | 12.66 | 11.86 | 8.82 | 7.89 | 7.21 | 6.81 | 6.52 | 6.12 | 5.84 | 5.45 / 8.37 | |
| GHLC-23 | 12.71 | 11.94 | 8.86 | 7.93 | 7.23 | 6.82 | 6.54 | 6.14 | 5.85 | 5.45 / 8.40 | |
| GHLC-24 | 12.68 | 11.89 | 8.81 | 7.89 | 7.24 | 6.83 | 6.55 | 6.15 | 5.87 | 5.50 / 8.44 | |
| GHLC-25 | 12.49 | 11.67 | 8.69 | 7.81 | 7.18 | 6.79 | 6.52 | 6.12 | 5.85 | 5.52 / 8.41 | |
| GHLC-26 | 12.15 | 11.27 | 8.56 | 7.69 | 7.13 | 6.76 | 6.51 | 6.12 | 5.84 | 5.41 / 8.46 | |
| GHLC-27 | 11.82 | 10.90 | 8.34 | 7.62 | 7.10 | 6.74 | 6.49 | 6.13 | 5.87 | 5.54 / 8.59 | |
| GHLC-28 | 12.16 | 11.29 | 8.51 | 7.64 | 7.13 | 6.75 | 6.50 | 6.11 | 5.84 | 5.49 / 8.57 | |
| GHLC-29 | 11.69 | 10.80 | 8.37 | 7.61 | 7.14 | 6.79 | 6.55 | 6.19 | 5.92 | 5.58 / 8.72 | |
| GHLC-30 | 11.70 | 10.79 | 8.41 | 7.69 | 7.22 | 6.88 | 6.63 | 6.27 | 6.00 | 5.61 / 9.53 | |
| GHLC-31 | 11.46 | 10.46 | 8.23 | 7.55 | 7.10 | 6.77 | 6.54 | 6.18 | 5.92 | 5.56 / 8.79 | |
| GHLC-32 | 11.08 | 10.10 | 8.01 | 7.43 | 7.03 | 6.70 | 6.48 | 6.12 | 5.86 | 5.58 / 9.03 | |
| GHLC-33 | 11.50 | 10.56 | 8.24 | 7.50 | 7.11 | 6.78 | 6.52 | 6.15 | 5.88 | 5.62 / 9.21 | |
| GHLC-34 | 11.14 | 10.15 | 8.03 | 7.40 | 7.05 | 6.74 | 6.49 | 6.13 | 5.86 | 5.61 / 9.22 | |
| GHLC-35 | 11.23 | 10.28 | 8.08 | 7.42 | 7.05 | 6.72 | 6.48 | 6.11 | 5.85 | 5.62 / 9.23 | |
| GHLC-36 | 11.82 | 10.85 | 8.30 | 7.63 | 7.17 | 6.82 | 6.56 | 6.19 | 5.91 | 5.64 / 9.24 | |
| GHLC-37 | 11.65 | 10.66 | 8.22 | 7.51 | 7.12 | 6.77 | 6.52 | 6.15 | 5.88 | 5.64 / 9.25 | |

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、日興シチグループ

| 回号 | Yield Curve Scenarios (%) | | | | | | | | | 最低 / 最高(%) |
|----------|-----------------------------|--------|--------|-------|------|------|-------|-------|-------|--------------|
| | -300bp | -200bp | -100bp | -50bp | 0bp | 50bp | 100bp | 200bp | 300bp | |
| GHLC-38 | 11.99 | 11.03 | 8.35 | 7.60 | 7.13 | 6.77 | 6.52 | 6.14 | 5.87 | 5.67 / 9.05 |
| GHLC-39 | 11.90 | 10.88 | 8.33 | 7.66 | 7.19 | 6.82 | 6.58 | 6.20 | 5.93 | 5.67 / 9.26 |
| GHLC-40 | 12.46 | 11.45 | 8.53 | 7.69 | 7.22 | 6.82 | 6.57 | 6.17 | 5.90 | 5.69 / 8.61 |
| GHLC-41 | 11.91 | 10.93 | 8.29 | 7.56 | 7.14 | 6.78 | 6.53 | 6.15 | 5.87 | 5.69 / 8.83 |
| GHLC-42 | 12.49 | 11.51 | 8.60 | 7.80 | 7.27 | 6.89 | 6.63 | 6.24 | 5.96 | 5.73 / 9.28 |
| GHLC-43 | 12.87 | 11.91 | 8.70 | 7.79 | 7.20 | 6.83 | 6.56 | 6.16 | 5.89 | 5.77 / 8.54 |
| GHLC-44 | 13.64 | 12.62 | 9.10 | 8.06 | 7.35 | 6.93 | 6.63 | 6.21 | 5.92 | 5.85 / 8.69 |
| GHLC-45 | 13.36 | 12.37 | 8.90 | 7.97 | 7.30 | 6.91 | 6.62 | 6.21 | 5.93 | 5.82 / 8.66 |
| GHLC-46 | 13.50 | 12.48 | 8.95 | 7.97 | 7.31 | 6.90 | 6.62 | 6.21 | 5.93 | 5.85 / 8.62 |
| GHLC-47 | 13.55 | 12.54 | 8.95 | 7.93 | 7.30 | 6.90 | 6.61 | 6.20 | 5.92 | 5.89 / 8.65 |
| GHLC-48 | 12.87 | 11.76 | 8.64 | 7.77 | 7.21 | 6.85 | 6.59 | 6.21 | 5.92 | 5.80 / 8.58 |
| GHLC-49 | 12.83 | 11.76 | 8.56 | 7.70 | 7.15 | 6.80 | 6.54 | 6.15 | 5.87 | 5.81 / 8.54 |
| GHLC-50 | 13.74 | 12.61 | 9.03 | 8.01 | 7.36 | 6.96 | 6.67 | 6.26 | 5.97 | 5.89 / 8.83 |
| GHLC-51 | 13.19 | 12.07 | 8.70 | 7.80 | 7.22 | 6.86 | 6.58 | 6.19 | 5.91 | 5.85 / 8.58 |
| GHLC-52 | 12.92 | 11.79 | 8.58 | 7.78 | 7.21 | 6.87 | 6.61 | 6.22 | 5.94 | 5.84 / 8.58 |
| GHLC-53 | 13.31 | 12.11 | 8.75 | 7.86 | 7.30 | 6.94 | 6.67 | 6.28 | 5.99 | 5.88 / 9.01 |
| JHF-S1 | 12.85 | 12.12 | 9.21 | 8.08 | 7.31 | 6.80 | 6.44 | 6.00 | 5.70 | 4.89 / 9.88 |
| JHF-S2 | 12.86 | 12.14 | 9.18 | 8.11 | 7.30 | 6.79 | 6.44 | 5.99 | 5.70 | 4.89 / 9.92 |
| JHF-S3 | 12.87 | 12.12 | 9.22 | 8.12 | 7.31 | 6.80 | 6.44 | 6.01 | 5.70 | 4.89 / 9.96 |
| JHF-S4 | 12.77 | 11.98 | 9.01 | 7.94 | 7.25 | 6.79 | 6.48 | 6.08 | 5.80 | 5.01 / 9.57 |
| JHF-S5 | 12.56 | 11.75 | 8.94 | 7.99 | 7.34 | 6.86 | 6.56 | 6.14 | 5.85 | 5.04 / 9.77 |
| JHF-S6 | 12.59 | 11.85 | 8.96 | 8.00 | 7.34 | 6.87 | 6.56 | 6.14 | 5.86 | 5.05 / 9.56 |
| JHF-S7 | 12.61 | 11.83 | 8.94 | 8.01 | 7.36 | 6.88 | 6.57 | 6.16 | 5.87 | 5.05 / 9.72 |
| JHF-S8 | 11.73 | 10.95 | 8.49 | 7.72 | 7.14 | 6.73 | 6.46 | 6.08 | 5.80 | 5.17 / 9.73 |
| GHLC-S1 | 12.91 | 12.23 | 9.38 | 8.17 | 7.31 | 6.67 | 6.25 | 5.77 | 5.45 | 4.70 / 9.98 |
| GHLC-S2 | 12.90 | 12.21 | 9.36 | 8.12 | 7.30 | 6.67 | 6.25 | 5.77 | 5.45 | 4.68 / 10.00 |
| GHLC-S3 | 12.92 | 12.29 | 9.41 | 8.16 | 7.32 | 6.68 | 6.27 | 5.80 | 5.49 | 4.74 / 9.77 |
| GHLC-S4 | 12.97 | 12.30 | 9.42 | 8.20 | 7.39 | 6.77 | 6.37 | 5.89 | 5.57 | 4.80 / 9.64 |
| GHLC-S5 | 13.01 | 12.29 | 9.42 | 8.22 | 7.41 | 6.79 | 6.38 | 5.90 | 5.59 | 4.77 / 9.80 |
| GHLC-S6 | 12.89 | 12.24 | 9.35 | 8.21 | 7.39 | 6.81 | 6.42 | 5.95 | 5.63 | 4.79 / 9.89 |
| GHLC-S7 | 12.91 | 12.20 | 9.31 | 8.21 | 7.39 | 6.80 | 6.42 | 5.94 | 5.63 | 4.81 / 9.91 |
| GHLC-S8 | 12.86 | 12.17 | 9.37 | 8.21 | 7.38 | 6.80 | 6.41 | 5.95 | 5.64 | 4.82 / 9.94 |
| GHLC-S9 | 13.69 | 12.94 | 9.60 | 8.25 | 7.36 | 6.79 | 6.41 | 5.94 | 5.63 | 4.81 / 9.95 |
| GHLC-S10 | 13.51 | 12.87 | 9.56 | 8.18 | 7.34 | 6.79 | 6.40 | 5.94 | 5.63 | 4.81 / 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。