

P S J 予測統計値
(中央値)

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、メルカント・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	13.22	12.57	9.85	8.79	8.46	7.79	7.52	7.22	7.11	7.44 /	9.98
JHF-2	13.34	12.45	9.67	8.74	8.30	7.79	7.51	7.21	7.11	7.45 /	9.97
JHF-3	13.42	12.66	9.66	8.69	8.21	7.83	7.53	7.24	7.14	7.49 /	9.98
JHF-4	13.73	12.95	9.77	8.73	8.23	7.89	7.58	7.28	7.15	7.52 /	10.01
JHF-5	14.06	13.17	9.94	8.85	8.27	7.94	7.49	7.28	7.16	7.55 /	10.09
JHF-6	13.89	12.78	9.82	8.80	8.23	7.92	7.46	7.23	7.12	7.47 /	10.08
JHF-7	13.24	12.04	9.40	8.68	8.15	7.79	7.52	7.30	7.19	7.50 /	10.00
JHF-8	13.78	12.84	9.76	8.79	8.21	7.88	7.47	7.22	7.03	7.42 /	10.10
JHF-9	13.25	12.30	9.41	8.73	8.17	7.85	7.46	7.24	7.12	7.39 /	10.04
JHF-10	12.82	11.84	9.25	8.54	8.16	7.72	7.50	7.33	7.24	7.47 /	9.99
JHF-11	13.29	12.51	9.52	8.64	8.25	7.89	7.53	7.38	7.27	7.47 /	10.06
JHF-12	13.46	12.24	9.49	8.67	8.29	7.94	7.57	7.41	7.30	7.36 /	10.07
JHF-13	13.08	12.16	9.43	8.71	8.33	7.92	7.66	7.45	7.32	7.32 /	10.44
JHF-14	12.83	11.97	9.27	8.61	8.25	7.72	7.62	7.42	7.28	7.40 /	10.02
GHLC-1	12.96	11.90	9.05	8.12	7.49	6.89	6.45	5.78	5.24	4.74 /	8.79
GHLC-2	12.57	11.81	9.14	8.10	7.44	6.94	6.37	5.79	5.30	4.79 /	8.95
GHLC-3	12.79	12.21	9.35	8.12	7.48	6.95	6.31	5.81	5.32	4.83 /	9.17
GHLC-4	12.69	11.70	8.75	7.81	7.24	6.91	6.44	5.76	5.30	4.79 /	9.23
GHLC-5	12.83	11.61	8.89	8.16	7.29	6.89	6.40	5.81	5.33	4.90 /	8.96
GHLC-6	12.66	11.37	8.95	8.50	7.39	6.93	6.54	5.83	5.38	4.97 /	8.98
GHLC-7	12.54	12.08	9.14	8.49	7.43	6.89	6.56	5.79	5.38	5.00 /	9.18
GHLC-8	12.44	11.79	9.02	8.59	7.46	6.92	6.57	5.84	5.40	5.07 /	8.84
GHLC-9	12.34	11.83	8.93	8.42	7.41	6.92	6.53	5.84	5.42	5.08 /	8.81
GHLC-10	12.48	12.00	9.04	8.38	7.37	6.90	6.54	5.81	5.43	5.09 /	8.76
GHLC-11	12.16	11.83	8.93	8.17	7.33	6.88	6.53	5.80	5.45	5.10 /	8.91
GHLC-12	11.99	11.26	9.01	8.05	7.37	6.89	6.45	5.72	5.47	5.18 /	8.80
GHLC-13	12.22	11.29	9.18	8.34	7.50	6.93	6.48	5.75	5.48	5.23 /	9.02
GHLC-14	12.36	11.33	9.08	8.25	7.37	6.93	6.53	5.79	5.48	5.18 /	8.44
GHLC-15	12.28	11.32	9.08	8.21	7.34	6.89	6.49	5.77	5.48	5.20 /	8.52
GHLC-16	12.21	11.14	9.03	8.20	7.41	6.93	6.47	5.74	5.48	5.20 /	8.80
GHLC-17	12.17	11.33	9.15	8.21	7.41	6.94	6.50	5.77	5.52	5.24 /	8.57
GHLC-18	12.00	11.15	9.22	8.14	7.44	6.90	6.47	5.75	5.50	5.27 /	8.70
GHLC-19	11.99	11.17	9.25	8.12	7.44	6.90	6.47	5.76	5.52	5.29 /	8.59
GHLC-20	11.91	10.89	9.08	8.06	7.33	6.87	6.44	5.74	5.55	5.34 /	8.33
GHLC-21	11.87	10.83	9.20	8.14	7.46	6.87	6.42	5.76	5.58	5.39 /	8.69
GHLC-22	12.11	11.10	9.14	8.14	7.35	6.90	6.46	5.76	5.58	5.45 /	8.37
GHLC-23	12.19	11.17	9.16	8.15	7.37	6.90	6.46	5.78	5.59	5.45 /	8.40
GHLC-24	12.11	11.14	9.11	8.11	7.34	6.87	6.46	5.80	5.62	5.50 /	8.44
GHLC-25	11.78	10.74	9.01	7.99	7.30	6.78	6.42	5.80	5.62	5.52 /	8.41
GHLC-26	11.63	10.58	8.89	7.81	7.23	6.73	6.33	5.74	5.57	5.41 /	8.46
GHLC-27	11.08	10.12	8.62	7.69	7.16	6.64	6.31	5.80	5.69	5.54 /	8.59
GHLC-28	11.58	10.66	8.83	7.79	7.22	6.74	6.35	5.77	5.62	5.49 /	8.57
GHLC-29	10.58	10.07	8.63	7.73	7.19	6.64	6.30	5.82	5.71	5.58 /	8.72
GHLC-30	10.55	9.95	8.51	7.67	7.14	6.62	6.30	5.88	5.77	5.61 /	9.53
GHLC-31	10.50	9.83	8.40	7.63	7.11	6.56	6.24	5.83	5.73	5.56 /	8.79
GHLC-32	10.22	9.73	8.20	7.52	7.04	6.53	6.20	5.84	5.73	5.58 /	9.03
GHLC-33	10.54	9.96	8.34	7.61	7.09	6.59	6.27	5.85	5.74	5.62 /	9.21
GHLC-34	10.37	9.78	8.12	7.50	7.00	6.52	6.19	5.85	5.74	5.61 /	9.22
GHLC-35	10.44	9.86	8.17	7.51	6.95	6.57	6.21	5.87	5.76	5.62 /	9.23
GHLC-36	11.04	10.13	8.47	7.68	7.17	6.62	6.29	5.90	5.78	5.64 /	9.24
GHLC-37	11.01	10.03	8.29	7.60	7.11	6.59	6.26	5.88	5.77	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	11.01	10.24	8.44	7.73	7.23	6.67	6.34	5.89	5.77	5.67 /	9.05
GHLC-39	10.98	10.08	8.45	7.68	7.18	6.64	6.30	5.92	5.80	5.67 /	9.26
GHLC-40	11.61	10.44	8.64	7.88	7.31	6.77	6.40	5.91	5.79	5.69 /	8.61
GHLC-41	10.84	10.24	8.41	7.72	7.21	6.59	6.32	5.93	5.81	5.69 /	8.83
GHLC-42	11.23	10.54	8.60	7.83	7.31	6.78	6.38	5.99	5.85	5.73 /	9.28
GHLC-43	11.65	10.94	8.65	7.95	7.38	6.81	6.45	5.96	5.83	5.77 /	8.54
GHLC-44	12.81	11.60	8.98	8.17	7.53	7.07	6.53	5.99	5.87	5.85 /	8.69
GHLC-45	12.34	11.43	8.87	8.08	7.41	7.00	6.51	6.00	5.88	5.82 /	8.66
GHLC-46	12.49	11.46	8.88	8.08	7.44	6.96	6.54	6.01	5.88	5.85 /	8.62
GHLC-47	12.59	11.60	8.85	8.08	7.41	7.02	6.49	6.04	5.91	5.89 /	8.65
GHLC-48	11.79	10.57	8.60	7.86	7.27	6.86	6.42	6.03	5.89	5.80 /	8.58
GHLC-49	11.74	10.71	8.60	7.82	7.23	6.86	6.41	6.01	5.88	5.81 /	8.54
GHLC-50	12.64	11.53	8.88	8.06	7.38	7.02	6.53	6.07	5.94	5.89 /	8.83
GHLC-51	12.02	10.95	8.63	7.89	7.27	6.93	6.45	6.04	5.91	5.85 /	8.58
GHLC-52	11.75	10.69	8.56	7.79	7.25	6.85	6.42	6.05	5.91	5.84 /	8.58
GHLC-53	12.21	10.79	8.69	7.86	7.31	6.91	6.49	6.08	5.95	5.88 /	9.01
JHF-S1	11.97	11.26	9.44	8.33	7.47	6.76	6.46	5.87	5.48	4.89 /	9.88
JHF-S2	11.98	11.27	9.33	8.42	7.42	6.70	6.47	5.87	5.49	4.89 /	9.92
JHF-S3	12.00	11.33	9.41	8.40	7.38	6.71	6.46	5.89	5.51	4.89 /	9.96
JHF-S4	12.05	11.31	9.31	8.03	7.25	6.72	6.54	5.83	5.54	5.01 /	9.57
JHF-S5	11.93	11.11	9.24	8.09	7.09	6.73	6.51	5.76	5.55	5.04 /	9.77
JHF-S6	11.94	11.21	9.19	8.14	7.12	6.75	6.50	5.77	5.55	5.05 /	9.56
JHF-S7	12.00	11.29	9.20	8.13	7.14	6.78	6.51	5.77	5.56	5.05 /	9.72
JHF-S8	10.99	10.27	8.75	7.76	6.92	6.73	6.31	5.74	5.58	5.17 /	9.73
GHLC-S1	12.55	11.46	9.57	8.51	7.43	6.87	6.36	5.81	5.22	4.70 /	9.98
GHLC-S2	12.32	11.40	9.61	8.54	7.37	6.87	6.37	5.82	5.20	4.68 /	10.00
GHLC-S3	12.31	11.84	9.66	8.54	7.38	6.90	6.35	5.87	5.25	4.74 /	9.77
GHLC-S4	12.41	11.53	9.79	8.62	7.50	6.91	6.41	5.84	5.32	4.80 /	9.64
GHLC-S5	12.58	11.81	9.78	8.59	7.48	6.90	6.55	5.83	5.32	4.77 /	9.80
GHLC-S6	11.93	11.29	9.70	8.60	7.56	6.94	6.38	5.85	5.45	4.79 /	9.89
GHLC-S7	12.29	11.24	9.45	8.61	7.54	6.93	6.37	5.85	5.45	4.81 /	9.91
GHLC-S8	11.92	11.27	9.77	8.60	7.55	6.92	6.38	5.84	5.44	4.82 /	9.94
GHLC-S9	12.60	11.81	9.53	8.45	7.50	6.92	6.37	5.84	5.44	4.81 /	9.95
GHLC-S10	12.62	11.93	9.66	8.39	7.51	6.90	6.37	5.84	5.44	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。