

P S J 予測統計値
(平均値)

2009年 6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：みずほ、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、JPモルガン、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	13.42	12.69	11.00	9.63	8.63	7.90	7.36	6.83	6.54	7.13 / 11.68		
JHF-2	13.36	12.65	10.97	9.60	8.62	7.88	7.35	6.82	6.53	7.12 / 11.61		
JHF-3	13.52	12.91	11.09	9.69	8.69	7.95	7.40	6.85	6.57	7.15 / 11.87		
JHF-4	13.76	13.10	11.25	9.81	8.75	7.99	7.43	6.88	6.58	7.17 / 11.83		
JHF-5	14.22	13.50	11.48	10.04	8.88	8.11	7.50	6.90	6.59	7.22 / 12.21		
JHF-6	13.93	13.22	11.29	9.84	8.79	8.06	7.46	6.89	6.59	7.18 / 11.99		
JHF-7	13.09	12.46	10.73	9.47	8.56	7.86	7.35	6.85	6.57	7.08 / 11.45		
JHF-8	13.87	13.15	11.25	9.82	8.78	8.01	7.46	6.90	6.60	7.17 / 11.97		
JHF-9	13.33	12.66	10.88	9.53	8.62	7.91	7.39	6.88	6.60	7.10 / 11.58		
JHF-10	12.75	12.13	10.48	9.29	8.47	7.78	7.33	6.86	6.59	7.05 / 11.30		
JHF-11	13.37	12.74	10.90	9.60	8.67	7.94	7.43	6.92	6.64	7.13 / 11.85		
JHF-12	13.29	12.63	10.87	9.56	8.64	7.92	7.43	6.93	6.64	7.13 / 11.75		
JHF-13	13.21	12.58	10.75	9.50	8.63	7.92	7.45	6.96	6.67	7.14 / 11.89		
JHF-14	12.93	12.22	10.51	9.36	8.50	7.85	7.39	6.93	6.66	7.11 / 11.51		
JHF-15	14.49	13.76	11.68	10.12	9.01	8.20	7.63	7.06	6.75	7.30 / 12.66		
JHF-16	15.27	14.53	12.27	10.51	9.23	8.37	7.75	7.12	6.79	7.39 / 13.09		
JHF-17	14.68	14.00	11.83	10.30	9.13	8.34	7.73	7.13	6.82	7.33 / 12.91		
JHF-18	14.42	13.69	11.64	10.13	9.03	8.24	7.68	7.11	6.81	7.30 / 12.55		
JHF-19	13.51	12.83	10.91	9.66	8.75	8.04	7.55	7.05	6.77	7.22 / 11.73		
JHF-20	13.76	13.04	11.07	9.79	8.84	8.11	7.61	7.10	6.81	7.25 / 11.96		
JHF-21	14.29	13.54	11.47	10.06	9.00	8.23	7.70	7.16	6.85	7.29 / 12.42		
JHF-22	14.36	13.66	11.53	10.06	9.01	8.26	7.73	7.19	6.88	7.31 / 12.57		
JHF-23	15.26	14.47	12.06	10.49	9.24	8.43	7.85	7.24	6.93	7.40 / 13.15		
JHF-24	14.93	14.09	11.81	10.34	9.18	8.39	7.83	7.25	6.94	7.37 / 13.02		
JHF-25	14.83	14.03	11.73	10.25	9.13	8.34	7.79	7.22	6.91	7.38 / 12.80		
GHLC-1	12.52	11.88	10.46	8.77	7.42	6.41	5.67	4.88	4.54	5.22 / 10.18		
GHLC-2	12.55	11.95	10.50	8.73	7.40	6.38	5.68	4.91	4.58	5.22 / 10.10		
GHLC-3	12.56	11.94	10.47	8.74	7.37	6.38	5.71	4.95	4.63	5.20 / 10.07		
GHLC-4	12.40	11.86	10.32	8.65	7.29	6.36	5.73	5.02	4.72	5.02 / 10.07		
GHLC-5	12.33	11.82	10.24	8.61	7.32	6.40	5.79	5.10	4.80	5.05 / 10.09		
GHLC-6	12.68	12.14	10.48	8.76	7.49	6.55	5.93	5.21	4.92	5.08 / 9.99		
GHLC-7	12.71	12.13	10.50	8.74	7.47	6.54	5.91	5.20	4.91	5.12 / 9.99		
GHLC-8	12.69	12.13	10.47	8.72	7.50	6.58	5.96	5.26	4.96	5.14 / 10.01		
GHLC-9	12.61	12.00	10.35	8.60	7.42	6.54	5.93	5.27	4.97	5.13 / 9.79		
GHLC-10	12.53	11.96	10.24	8.56	7.36	6.52	5.93	5.29	5.01	5.10 / 9.65		
GHLC-11	12.38	11.75	9.99	8.42	7.27	6.49	5.94	5.32	5.06	5.08 / 9.40		
GHLC-12	12.07	11.53	9.76	8.23	7.20	6.47	5.94	5.37	5.12	5.06 / 9.21		
GHLC-13	12.23	11.67	9.87	8.34	7.26	6.49	5.96	5.39	5.13	5.11 / 9.29		
GHLC-14	12.23	11.72	9.90	8.36	7.28	6.52	5.97	5.36	5.10	5.10 / 9.37		
GHLC-15	12.26	11.65	9.92	8.34	7.28	6.52	5.98	5.39	5.12	5.09 / 9.28		
GHLC-16	12.24	11.68	9.88	8.38	7.27	6.53	5.99	5.40	5.14	5.08 / 9.23		
GHLC-17	12.27	11.65	9.90	8.35	7.31	6.55	6.02	5.44	5.17	5.15 / 9.26		
GHLC-18	12.22	11.62	9.83	8.35	7.28	6.53	6.01	5.44	5.18	5.15 / 9.19		
GHLC-19	12.19	11.55	9.83	8.34	7.28	6.55	6.01	5.45	5.19	5.15 / 9.11		
GHLC-20	12.20	11.62	9.81	8.39	7.38	6.61	6.09	5.52	5.25	5.19 / 9.09		
GHLC-21	12.21	11.61	9.87	8.42	7.42	6.66	6.13	5.58	5.31	5.25 / 9.06		
GHLC-22	12.33	11.71	9.93	8.53	7.45	6.68	6.13	5.57	5.30	5.34 / 9.20		
GHLC-23	12.44	11.80	9.96	8.55	7.50	6.72	6.17	5.61	5.33	5.36 / 9.24		
GHLC-24	12.29	11.69	9.94	8.51	7.52	6.72	6.19	5.63	5.35	5.41 / 9.26		
GHLC-25	12.10	11.49	9.83	8.45	7.46	6.73	6.18	5.63	5.37	5.43 / 9.07		
GHLC-26	11.90	11.28	9.58	8.27	7.30	6.57	6.08	5.57	5.30	5.23 / 8.80		

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：みずほ、野村、三菱UFJ、コールドマン・サクス、カギン・スタンレー、クレディ・スイス、ドイツ、JPモルガン、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		
GHLC-27	11.16	10.53	9.15	7.99	7.15	6.47	6.03	5.59	5.34	5.34 /	8.44
GHLC-28	11.76	11.15	9.48	8.24	7.30	6.57	6.10	5.59	5.34	5.32 /	8.69
GHLC-29	11.08	10.45	9.04	7.94	7.12	6.46	6.04	5.60	5.36	5.37 /	8.54
GHLC-30	10.94	10.33	9.04	7.94	7.10	6.46	6.05	5.61	5.37	5.40 /	8.62
GHLC-31	10.71	10.13	8.85	7.77	6.99	6.38	5.99	5.57	5.33	5.31 /	8.30
GHLC-32	10.50	9.95	8.68	7.66	6.93	6.33	5.98	5.58	5.35	5.31 /	8.11
GHLC-33	10.92	10.28	8.92	7.87	7.04	6.42	6.03	5.60	5.36	5.36 /	8.38
GHLC-34	10.56	10.02	8.74	7.74	6.93	6.35	5.99	5.59	5.36	5.31 /	8.13
GHLC-35	10.70	10.11	8.77	7.79	6.97	6.37	6.00	5.59	5.36	5.32 /	8.19
GHLC-36	11.17	10.58	9.13	8.03	7.13	6.50	6.07	5.63	5.39	5.37 /	8.71
GHLC-37	11.04	10.46	9.06	7.91	7.08	6.45	6.04	5.60	5.36	5.37 /	8.55
GHLC-38	11.38	10.81	9.29	8.08	7.23	6.55	6.10	5.64	5.38	5.43 /	8.82
GHLC-39	11.27	10.63	9.16	8.06	7.16	6.51	6.08	5.64	5.38	5.39 /	8.75
GHLC-40	11.83	11.18	9.57	8.28	7.36	6.64	6.16	5.67	5.41	5.47 /	9.13
GHLC-41	11.36	10.70	9.25	8.07	7.23	6.55	6.11	5.65	5.40	5.42 /	8.84
GHLC-42	11.85	11.15	9.59	8.35	7.38	6.66	6.18	5.69	5.42	5.51 /	9.27
GHLC-43	12.27	11.54	9.86	8.50	7.51	6.75	6.22	5.70	5.43	5.58 /	9.53
GHLC-44	13.04	12.34	10.43	8.93	7.79	6.94	6.36	5.77	5.48	5.73 /	10.16
GHLC-45	12.73	11.98	10.17	8.75	7.68	6.87	6.31	5.74	5.47	5.66 /	9.90
GHLC-46	12.85	12.18	10.30	8.83	7.72	6.92	6.34	5.76	5.47	5.67 /	10.15
GHLC-47	12.92	12.21	10.30	8.86	7.74	6.96	6.35	5.77	5.47	5.69 /	10.07
GHLC-48	12.15	11.49	9.73	8.44	7.49	6.80	6.25	5.73	5.45	5.54 /	9.60
GHLC-49	12.21	11.49	9.76	8.46	7.46	6.77	6.23	5.71	5.44	5.54 /	9.54
GHLC-50	12.98	12.26	10.35	8.85	7.75	6.98	6.36	5.77	5.48	5.68 /	10.21
GHLC-51	12.44	11.74	9.92	8.58	7.56	6.84	6.27	5.74	5.46	5.59 /	9.74
GHLC-52	12.06	11.37	9.71	8.42	7.44	6.73	6.22	5.72	5.44	5.55 /	9.46
GHLC-53	12.43	11.71	9.88	8.57	7.56	6.82	6.28	5.76	5.47	5.59 /	9.82
JHF-S1	12.43	11.82	10.32	8.73	7.48	6.56	5.92	5.18	4.87	5.01 /	9.75
JHF-S2	12.41	11.82	10.24	8.65	7.45	6.54	5.90	5.17	4.88	5.01 /	9.77
JHF-S3	12.41	11.82	10.25	8.70	7.48	6.56	5.92	5.20	4.90	5.03 /	9.74
JHF-S4	12.33	11.75	10.07	8.56	7.38	6.54	5.95	5.29	5.00	5.01 /	9.50
JHF-S5	12.12	11.50	9.89	8.32	7.25	6.47	5.92	5.30	5.03	4.98 /	9.32
JHF-S6	12.18	11.55	9.93	8.44	7.29	6.50	5.93	5.32	5.04	4.99 /	9.33
JHF-S7	12.16	11.61	9.91	8.38	7.28	6.49	5.93	5.31	5.04	5.00 /	9.34
JHF-S8	11.67	11.10	9.43	8.03	7.08	6.40	5.93	5.41	5.16	4.97 /	8.92
JHF-S9	11.61	11.10	9.37	8.03	7.08	6.39	5.92	5.40	5.16	4.98 /	8.92
JHF-S10	11.35	10.84	9.15	7.98	7.12	6.44	6.01	5.53	5.29	5.12 /	8.52
JHF-S11	11.85	11.32	9.54	8.32	7.35	6.62	6.14	5.63	5.37	5.31 /	8.89
JHF-S12	12.12	11.54	9.77	8.45	7.49	6.74	6.26	5.73	5.46	5.40 /	9.34
JHF-S13	7.81	7.59	6.93	6.07	5.43	4.93	4.55	4.06	3.83	2.98 /	7.56
GHLC-S1	12.32	11.70	10.29	8.69	7.44	6.48	5.75	4.97	4.63	5.09 /	9.81
GHLC-S2	12.19	11.59	10.18	8.66	7.40	6.44	5.74	4.96	4.62	5.07 /	9.76
GHLC-S3	12.22	11.66	10.23	8.72	7.42	6.44	5.76	4.99	4.65	5.11 /	9.82
GHLC-S4	12.32	11.71	10.23	8.67	7.42	6.47	5.80	5.04	4.71	5.06 /	9.84
GHLC-S5	12.28	11.69	10.24	8.68	7.40	6.45	5.79	5.03	4.71	5.03 /	9.84
GHLC-S6	12.36	11.81	10.35	8.72	7.48	6.52	5.86	5.11	4.79	5.02 /	9.84
GHLC-S7	12.35	11.79	10.34	8.74	7.47	6.52	5.86	5.11	4.79	5.02 /	9.84
GHLC-S8	12.37	11.80	10.32	8.77	7.47	6.52	5.86	5.10	4.79	5.03 /	9.84
GHLC-S9	12.31	11.80	10.27	8.73	7.45	6.51	5.86	5.11	4.79	5.01 /	9.81
GHLC-S10	12.36	11.75	10.25	8.70	7.45	6.51	5.85	5.10	4.78	5.00 /	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（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。