

P S J 予測統計値  
(中央値)

2010年 5月 17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、日興コーディアル、野村、三菱UFJ銀行、三井住友銀行、ゴールドマン・サックス、モルガン・スタンレー-MUFG、クレディ・スイス、ドイツ、JPモルガン、バークレイズ・キャピタル、UBS、メリルリンチ日本、大和証券キャピタル・マーケット、新生、シティグループ												
回号	Yield Curve Scenarios ( % )										最低 / 最高( % )	
	-300bp	-200bp	-100bp	-50bp	0bp	50bp	100bp	200bp	300bp			
JHF-1	12.98	12.98	10.42	9.50	8.63	7.72	7.40	6.95	6.65	6.22 / 10.37		
JHF-2	12.94	12.90	10.34	9.46	8.63	7.78	7.37	6.95	6.65	6.18 / 10.31		
JHF-3	13.24	12.94	10.45	9.31	8.73	7.78	7.41	6.97	6.67	6.34 / 10.49		
JHF-4	13.86	13.08	10.54	9.49	8.82	7.85	7.43	6.96	6.67	6.57 / 10.43		
JHF-5	13.89	13.48	10.80	9.68	8.95	7.87	7.50	6.98	6.68	6.83 / 10.79		
JHF-6	13.55	13.10	10.54	9.52	8.80	7.92	7.48	6.96	6.66	6.52 / 10.60		
JHF-7	13.05	12.38	9.93	9.09	8.38	7.78	7.37	6.89	6.61	5.89 / 10.15		
JHF-8	13.72	12.92	10.35	9.44	8.67	7.97	7.47	6.99	6.64	6.31 / 10.54		
JHF-9	13.42	12.43	9.98	9.08	8.37	7.66	7.26	6.90	6.58	5.96 / 10.21		
JHF-10	13.01	11.88	9.53	8.75	8.10	7.63	7.29	6.84	6.60	5.72 / 9.95		
JHF-11	12.97	12.32	9.97	8.99	8.36	7.70	7.35	6.90	6.63	6.00 / 10.38		
JHF-12	13.03	12.16	9.83	8.94	8.27	7.73	7.33	6.88	6.64	6.00 / 10.29		
JHF-13	13.05	12.00	9.77	8.88	8.20	7.66	7.28	6.86	6.62	5.86 / 10.36		
JHF-14	12.75	11.84	9.58	8.75	8.01	7.60	7.25	6.84	6.61	5.80 / 10.06		
JHF-15	14.06	13.14	10.30	9.37	8.57	7.85	7.40	7.03	6.65	6.61 / 10.97		
JHF-16	14.23	13.45	11.10	9.61	8.69	7.97	7.46	7.10	6.68	7.46 / 11.29		
JHF-17	14.12	13.42	10.55	9.45	8.57	7.86	7.42	7.05	6.68	6.71 / 11.09		
JHF-18	13.82	12.65	10.26	9.30	8.45	7.78	7.38	6.98	6.68	6.59 / 10.81		
JHF-19	13.16	12.35	9.71	8.95	8.17	7.61	7.30	6.85	6.64	6.14 / 10.15		
JHF-20	13.60	12.54	9.83	9.04	8.24	7.66	7.35	6.88	6.66	6.24 / 10.30		
JHF-21	13.79	13.01	10.11	9.17	8.35	7.72	7.37	6.94	6.68	6.48 / 10.64		
JHF-22	13.78	13.07	10.07	9.14	8.36	7.73	7.39	6.94	6.70	6.57 / 10.75		
JHF-23	14.43	13.56	10.54	9.40	8.52	7.80	7.44	7.01	6.73	6.96 / 11.22		
JHF-24	14.09	13.50	10.29	9.21	8.46	7.78	7.43	6.97	6.73	6.61 / 11.10		
JHF-25	14.17	13.54	10.25	9.16	8.48	7.78	7.43	6.96	6.72	6.60 / 10.99		
JHF-26	14.44	13.73	10.36	9.36	8.62	7.86	7.49	7.02	6.75	6.97 / 11.04		
JHF-27	14.08	13.83	10.25	9.25	8.57	7.82	7.46	6.99	6.76	6.63 / 10.88		
JHF-28	13.39	13.08	9.71	8.96	8.20	7.70	7.39	6.95	6.76	6.30 / 10.36		
JHF-29	13.27	12.81	9.62	8.89	8.14	7.71	7.39	6.96	6.78	6.22 / 10.18		
JHF-30	12.85	12.32	9.46	8.77	8.05	7.72	7.37	6.97	6.79	6.18 / 9.93		
JHF-31	12.79	11.96	9.37	8.69	8.01	7.67	7.33	6.98	6.81	6.07 / 9.78		
JHF-32	13.11	12.40	9.53	8.82	8.09	7.79	7.42	7.06	6.88	6.13 / 10.10		
JHF-33	12.73	11.83	9.34	8.66	8.01	7.69	7.35	7.04	6.88	6.05 / 9.86		
JHF-34	12.82	11.93	9.40	8.70	8.05	7.73	7.40	7.09	6.93	6.05 / 10.03		
JHF-35	10.59	10.14	8.67	8.05	7.69	7.48	7.27	7.04	6.90	5.67 / 9.62		
JHF-36	10.43	10.03	8.55	8.00	7.67	7.49	7.27	7.06	6.92	5.60 / 9.55		
GHLC-1	12.50	12.50	11.09	9.44	7.40	6.77	6.50	5.35	4.94	5.47 / 9.90		
GHLC-2	12.62	12.62	11.14	9.24	7.47	6.77	6.57	5.33	4.92	5.69 / 9.71		
GHLC-3	12.79	12.79	11.09	9.10	7.58	6.85	6.57	5.38	4.97	5.65 / 9.54		
GHLC-4	12.57	12.57	10.83	9.09	7.56	6.68	6.36	5.36	4.95	5.97 / 9.75		
GHLC-5	12.63	12.63	10.80	9.09	7.58	6.71	6.38	5.42	5.01	6.17 / 9.74		
GHLC-6	12.91	12.91	10.55	9.26	7.86	6.80	6.39	5.45	5.07	6.19 / 9.55		
GHLC-7	12.99	12.99	10.66	9.22	8.01	6.79	6.37	5.46	5.08	6.12 / 9.19		
GHLC-8	12.98	12.98	10.58	9.19	7.99	6.85	6.38	5.51	5.11	6.12 / 9.27		
GHLC-9	12.96	12.96	10.36	9.02	7.82	6.89	6.29	5.52	5.16	5.99 / 9.10		
GHLC-10	12.73	12.73	10.11	8.89	7.73	6.87	6.23	5.46	5.18	5.86 / 9.00		
GHLC-11	12.44	12.44	9.65	8.65	7.54	6.74	6.13	5.43	5.17	5.46 / 9.17		
GHLC-12	12.19	11.98	9.36	8.35	7.53	6.65	6.13	5.47	5.19	5.44 / 8.71		
GHLC-13	12.30	11.92	9.48	8.34	7.59	6.71	6.13	5.45	5.25	5.61 / 8.61		
GHLC-14	12.39	12.15	9.52	8.57	7.67	6.74	6.15	5.46	5.16	5.37 / 8.66		
GHLC-15	12.28	12.09	9.42	8.34	7.60	6.69	6.14	5.52	5.18	5.40 / 8.67		

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、日興コーディアル、野村、三菱UFJモルガン・スタンレー、ゴールドマン・サックス、モルガン・スタンレー・MUFG、クレディ・スイス、ドイツ、JPモルガン、バークレイズ・キャピタル、UBS、メリリッジ日本、大和証券キャピタル・マーケット、新生、シティグループ

回号	Yield Curve Scenarios ( % )										最低 / 最高 ( % )	
	-300bp	-200bp	-100bp	-50bp	0bp	50bp	100bp	200bp	300bp			
GHLC-16	12.24	11.93	9.39	8.31	7.60	6.67	6.12	5.54	5.21	5.49 / 8.61		
GHLC-17	12.24	12.05	9.37	8.39	7.57	6.66	6.18	5.54	5.24	5.53 / 8.62		
GHLC-18	12.15	12.02	9.41	8.15	7.54	6.65	6.23	5.54	5.26	5.38 / 8.54		
GHLC-19	12.07	11.76	9.29	8.05	7.49	6.61	6.21	5.51	5.20	5.35 / 8.51		
GHLC-20	12.02	11.75	9.26	8.11	7.45	6.59	6.33	5.60	5.28	5.29 / 8.66		
GHLC-21	11.97	11.79	9.30	8.02	7.49	6.78	6.35	5.68	5.35	5.43 / 8.71		
GHLC-22	12.22	12.00	9.50	8.11	7.62	6.91	6.16	5.75	5.41	5.56 / 8.90		
GHLC-23	12.24	12.05	9.47	8.05	7.64	6.96	6.26	5.76	5.41	5.58 / 8.96		
GHLC-24	12.19	11.54	9.45	8.07	7.65	6.99	6.25	5.81	5.46	5.46 / 8.99		
GHLC-25	11.93	11.71	9.33	7.98	7.53	7.13	6.38	5.81	5.46	5.44 / 9.01		
GHLC-26	11.67	11.42	9.05	7.96	7.32	6.76	6.28	5.70	5.38	5.28 / 8.66		
GHLC-27	10.61	10.61	8.45	7.84	7.31	6.75	6.33	5.69	5.41	5.10 / 8.80		
GHLC-28	11.48	11.42	9.02	7.82	7.39	6.82	6.36	5.71	5.46	5.35 / 8.81		
GHLC-29	10.53	10.53	8.20	7.84	7.29	6.69	6.31	5.72	5.49	5.13 / 8.77		
GHLC-30	10.40	10.20	8.20	7.88	7.27	6.60	6.25	5.75	5.51	5.04 / 8.81		
GHLC-31	10.34	10.10	8.06	7.70	7.09	6.52	6.17	5.67	5.44	4.92 / 8.62		
GHLC-32	10.25	9.72	7.99	7.54	6.99	6.53	6.07	5.68	5.47	4.87 / 8.51		
GHLC-33	10.50	10.35	8.10	7.73	7.13	6.54	6.18	5.60	5.49	5.04 / 8.65		
GHLC-34	10.30	10.09	7.96	7.58	6.95	6.49	6.08	5.64	5.48	4.97 / 8.44		
GHLC-35	10.36	10.27	7.99	7.60	7.00	6.50	6.09	5.60	5.46	5.03 / 8.44		
GHLC-36	11.16	10.59	8.22	7.82	7.35	6.65	6.23	5.67	5.51	5.10 / 8.64		
GHLC-37	11.02	10.48	8.18	7.73	7.26	6.60	6.17	5.63	5.48	5.04 / 8.55		
GHLC-38	11.39	10.76	8.40	7.91	7.52	6.72	6.29	5.63	5.49	5.24 / 8.69		
GHLC-39	11.41	10.55	8.28	7.77	7.39	6.64	6.18	5.65	5.50	5.20 / 8.54		
GHLC-40	12.03	11.25	8.51	8.08	7.61	6.82	6.35	5.68	5.51	5.54 / 8.83		
GHLC-41	11.45	10.67	8.28	7.82	7.39	6.62	6.20	5.68	5.54	5.27 / 8.59		
GHLC-42	12.02	11.01	8.56	8.07	7.63	6.82	6.30	5.75	5.54	5.48 / 8.77		
GHLC-43	12.04	11.48	9.01	8.29	7.68	6.95	6.40	5.74	5.57	5.85 / 8.95		
GHLC-44	12.57	12.34	9.66	8.57	7.83	7.08	6.54	5.85	5.60	6.19 / 9.25		
GHLC-45	12.28	11.92	9.34	8.42	7.73	7.06	6.45	5.75	5.58	6.04 / 9.04		
GHLC-46	12.27	11.94	9.45	8.46	7.72	7.07	6.51	5.79	5.59	6.06 / 9.06		
GHLC-47	12.50	12.03	9.40	8.45	7.86	7.12	6.52	5.76	5.54	6.07 / 8.96		
GHLC-48	12.07	11.14	8.72	8.02	7.74	6.80	6.28	5.75	5.52	5.55 / 8.60		
GHLC-49	12.12	11.33	8.76	8.00	7.75	6.79	6.26	5.71	5.53	5.58 / 8.53		
GHLC-50	12.35	12.02	9.34	8.38	7.85	7.10	6.48	5.77	5.57	6.03 / 8.94		
GHLC-51	12.06	11.56	8.92	8.10	7.82	6.88	6.32	5.68	5.54	5.79 / 8.57		
GHLC-52	12.22	11.17	8.67	7.92	7.78	6.70	6.14	5.71	5.52	5.56 / 8.40		
GHLC-53	12.35	11.38	8.80	8.02	7.80	6.79	6.20	5.77	5.56	5.79 / 8.56		
JHF-S1	12.34	12.34	10.13	8.82	7.57	6.65	6.32	5.47	5.09	6.00 / 9.24		
JHF-S2	12.28	12.28	10.06	8.80	7.57	6.63	6.30	5.48	5.12	5.98 / 9.07		
JHF-S3	12.28	12.28	10.01	8.82	7.57	6.67	6.28	5.49	5.13	6.02 / 8.96		
JHF-S4	12.23	12.09	9.47	8.53	7.55	6.74	6.34	5.48	5.21	5.74 / 8.83		
JHF-S5	12.08	11.75	9.25	8.34	7.46	6.67	6.27	5.48	5.18	5.56 / 8.65		
JHF-S6	12.10	11.79	9.26	8.38	7.49	6.69	6.28	5.49	5.17	5.60 / 8.61		
JHF-S7	12.11	11.56	9.26	8.37	7.51	6.68	6.25	5.48	5.18	5.56 / 8.56		
JHF-S8	11.62	10.97	8.79	8.01	7.23	6.44	6.03	5.54	5.22	5.30 / 8.13		
JHF-S9	11.65	10.97	8.78	8.04	7.24	6.45	6.01	5.56	5.22	5.29 / 8.13		
JHF-S10	11.08	10.54	8.55	7.75	7.22	6.72	6.21	5.64	5.37	5.21 / 8.24		
JHF-S11	11.62	11.24	8.93	8.11	7.47	6.92	6.17	5.78	5.48	5.53 / 8.72		
JHF-S12	11.84	11.02	9.01	8.13	7.52	6.97	6.33	5.82	5.60	5.66 / 8.81		
JHF-S13	7.53	7.53	7.33	6.88	6.07	5.02	4.79	4.37	3.79	2.84 / 8.23		
JHF-S14	7.60	7.60	7.33	6.89	6.11	5.06	4.80	4.37	3.79	2.83 / 8.09		
JHF-S15	7.60	7.60	7.35	6.89	6.18	5.08	4.81	4.27	3.80	2.83 / 8.03		
JHF-S16	8.06	8.06	7.56	7.04	6.39	5.54	4.98	4.32	3.92	3.16 / 8.09		
JHF-S17	8.08	8.08	7.57	7.03	6.32	5.53	4.94	4.25	3.97	3.13 / 7.95		

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：みずほ、日興コーディアル、野村、三菱UFJモルガン・スタンレー、ゴールドマン・サックス、モルガン・スタンレー-MUFG、クレディ・スイス、ドイツ、JPモルガン、バークレイズ・キャピタル、UBS、メリリッチ日本、大和証券キャピタル・マーケット、新生、シティグループ

回号	Yield Curve Scenarios ( % )									最低 / 最高(%)
	-300bp	-200bp	-100bp	-50bp	0bp	50bp	100bp	200bp	300bp	
JHF-S18	8.12	8.12	7.60	7.05	6.34	5.58	4.98	4.24	3.97	3.12 / 7.87
GHLC-S1	11.83	11.83	10.18	8.44	7.14	6.69	6.36	5.38	5.07	6.45 / 9.92
GHLC-S2	11.71	11.71	10.19	8.43	7.16	6.75	6.36	5.34	5.04	6.42 / 9.97
GHLC-S3	11.89	11.89	10.23	8.60	7.21	6.60	6.38	5.33	5.06	6.48 / 9.91
GHLC-S4	11.89	11.89	10.24	8.66	7.29	6.61	6.43	5.42	5.10	6.32 / 9.85
GHLC-S5	11.91	11.91	10.19	8.70	7.30	6.60	6.44	5.41	5.09	6.25 / 9.75
GHLC-S6	12.16	12.16	10.23	8.94	7.66	6.59	6.43	5.49	5.09	6.19 / 9.52
GHLC-S7	12.12	12.12	10.16	8.94	7.55	6.63	6.40	5.46	5.06	6.19 / 9.51
GHLC-S8	12.12	12.12	10.30	8.90	7.76	6.62	6.41	5.47	5.07	6.19 / 9.48
GHLC-S9	12.16	12.16	10.10	8.90	7.50	6.62	6.39	5.44	5.06	6.20 / 9.47
GHLC-S10	12.13	12.13	10.09	8.90	7.48	6.60	6.40	5.46	5.07	6.17 / 9.41

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。
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。