

P S J 予測統計値
(中央値)

2010年 6月 15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・スタンレー、ゴールドマン・サックス、住友銀行・スタンレー・MUFG、クレディ・スイス、ドイツ、JP銀行・パナクレイズ・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	13.10	13.05	10.65	9.66	8.75	7.83	7.41	7.09	6.69	6.48 / 10.59	
JHF-2	13.45	12.99	10.61	9.66	8.70	7.84	7.41	7.04	6.67	6.32 / 10.53	
JHF-3	13.17	13.05	10.66	9.72	8.82	7.86	7.44	7.07	6.69	6.49 / 10.67	
JHF-4	13.38	13.21	10.74	9.75	8.96	7.96	7.46	7.07	6.69	6.74 / 10.62	
JHF-5	13.90	13.64	11.02	9.67	9.07	8.00	7.52	7.19	6.71	7.02 / 11.02	
JHF-6	13.99	13.25	10.76	9.74	9.00	8.00	7.48	7.13	6.68	6.69 / 10.83	
JHF-7	12.96	12.30	10.21	9.31	8.61	7.88	7.45	7.00	6.65	6.09 / 10.35	
JHF-8	13.94	13.33	10.57	9.64	8.89	8.02	7.52	7.09	6.66	6.47 / 10.78	
JHF-9	13.31	12.73	10.21	9.30	8.51	7.80	7.48	7.01	6.59	6.05 / 10.45	
JHF-10	13.30	12.00	9.78	9.00	8.31	7.75	7.43	6.91	6.61	5.79 / 10.15	
JHF-11	13.32	12.62	10.17	9.28	8.51	7.90	7.49	7.01	6.65	6.08 / 10.60	
JHF-12	13.93	12.27	10.07	9.22	8.42	7.85	7.46	6.97	6.66	6.10 / 10.48	
JHF-13	13.29	12.25	10.00	9.20	8.40	7.79	7.49	6.97	6.64	6.06 / 10.54	
JHF-14	12.75	11.96	9.80	9.03	8.30	7.73	7.46	6.91	6.62	5.87 / 10.23	
JHF-15	14.10	13.18	10.52	9.63	8.73	8.03	7.52	7.11	6.69	6.78 / 11.19	
JHF-16	14.62	13.80	11.39	9.87	8.91	8.15	7.68	7.21	6.69	7.70 / 11.55	
JHF-17	14.12	13.39	10.76	9.76	8.79	8.04	7.66	7.16	6.69	6.89 / 11.35	
JHF-18	13.99	13.11	10.48	9.50	8.70	7.92	7.59	7.09	6.69	6.73 / 11.05	
JHF-19	13.62	12.41	10.13	9.17	8.34	7.86	7.58	6.95	6.66	6.32 / 10.37	
JHF-20	13.63	12.60	10.24	9.28	8.35	7.90	7.58	6.98	6.67	6.35 / 10.51	
JHF-21	13.81	13.09	10.47	9.45	8.57	7.96	7.59	7.03	6.69	6.59 / 10.85	
JHF-22	13.78	13.06	10.47	9.41	8.58	7.97	7.54	7.03	6.70	6.68 / 10.96	
JHF-23	14.52	13.63	10.74	9.67	8.80	7.92	7.52	7.11	6.73	7.12 / 11.45	
JHF-24	14.10	13.57	10.66	9.51	8.71	8.01	7.60	7.07	6.74	6.83 / 11.33	
JHF-25	14.16	13.54	10.49	9.42	8.69	8.03	7.60	7.05	6.74	6.70 / 11.22	
JHF-26	14.45	13.64	10.60	9.49	8.81	8.14	7.63	7.11	6.76	7.14 / 11.26	
JHF-27	14.02	13.85	10.45	9.41	8.72	8.10	7.65	7.09	6.76	6.73 / 11.12	
JHF-28	13.32	13.22	10.01	9.06	8.44	7.96	7.55	6.96	6.75	6.34 / 10.55	
JHF-29	13.20	12.95	9.89	9.03	8.40	7.91	7.52	6.97	6.77	6.29 / 10.36	
JHF-30	12.80	12.46	9.78	8.94	8.31	7.86	7.49	6.98	6.79	6.26 / 10.13	
JHF-31	12.72	12.10	9.65	8.81	8.21	7.78	7.42	6.98	6.80	6.12 / 9.96	
JHF-32	13.04	12.56	9.84	9.02	8.34	7.89	7.53	7.05	6.86	6.18 / 10.29	
JHF-33	12.71	12.01	9.65	8.78	8.22	7.82	7.44	7.05	6.87	6.09 / 10.01	
JHF-34	12.79	12.07	9.70	8.85	8.26	7.85	7.49	7.09	6.91	6.10 / 10.20	
JHF-35	10.67	10.21	8.92	8.15	7.89	7.78	7.28	7.02	6.87	5.70 / 9.64	
JHF-36	10.38	10.10	8.81	8.07	7.89	7.79	7.27	7.04	6.89	5.67 / 9.57	
JHF-37	10.38	10.05	8.78	8.11	7.90	7.80	7.31	7.08	6.92	5.68 / 9.63	
GHLC-1	12.41	12.41	11.38	9.98	7.77	6.78	6.48	5.38	4.95	5.59 / 10.12	
GHLC-2	12.53	12.53	11.47	9.78	7.62	6.79	6.57	5.37	4.95	5.79 / 9.95	
GHLC-3	12.75	12.75	11.38	9.62	7.80	6.82	6.56	5.41	4.97	5.88 / 9.76	
GHLC-4	12.49	12.49	11.18	9.38	7.85	6.69	6.48	5.39	4.96	6.18 / 9.95	
GHLC-5	12.60	12.60	11.25	9.35	7.98	6.72	6.52	5.45	5.04	6.27 / 9.94	
GHLC-6	12.82	12.82	11.12	9.47	8.05	6.79	6.44	5.49	5.09	6.47 / 9.74	
GHLC-7	12.86	12.83	11.19	9.51	8.19	6.85	6.42	5.49	5.10	6.45 / 9.40	
GHLC-8	12.93	12.93	11.07	9.41	8.19	6.88	6.39	5.54	5.16	6.47 / 9.43	
GHLC-9	13.00	13.00	10.89	9.28	7.98	6.91	6.32	5.49	5.17	6.32 / 9.26	
GHLC-10	12.80	12.77	10.61	9.10	7.89	6.89	6.26	5.45	5.27	6.17 / 9.16	
GHLC-11	12.47	12.47	10.10	8.82	7.73	6.77	6.17	5.49	5.35	5.60 / 9.35	
GHLC-12	12.20	12.20	9.57	8.62	7.62	6.67	6.10	5.55	5.28	5.60 / 8.87	
GHLC-13	12.33	12.33	9.77	8.72	7.68	6.76	6.15	5.53	5.34	5.82 / 8.89	
GHLC-14	12.42	12.42	9.96	8.78	7.73	6.77	6.17	5.54	5.35	5.49 / 8.82	

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-15	12.29	12.29	9.74	8.70	7.68	6.74	6.16	5.54	5.32	5.55 / 8.85		
GHLC-16	12.25	12.25	9.61	8.64	7.68	6.68	6.12	5.59	5.29	5.63 / 8.77		
GHLC-17	12.27	12.27	9.69	8.66	7.67	6.73	6.21	5.59	5.35	5.67 / 8.81		
GHLC-18	12.17	12.17	9.63	8.66	7.63	6.74	6.22	5.64	5.35	5.67 / 8.72		
GHLC-19	12.07	12.05	9.50	8.55	7.59	6.65	6.21	5.63	5.31	5.49 / 8.66		
GHLC-20	12.04	12.04	9.47	8.55	7.53	6.72	6.33	5.73	5.33	5.40 / 8.79		
GHLC-21	11.97	11.97	9.49	8.39	7.55	6.91	6.34	5.82	5.35	5.55 / 8.88		
GHLC-22	12.20	11.80	9.71	8.43	7.70	7.02	6.20	5.80	5.42	5.68 / 9.11		
GHLC-23	12.25	12.07	9.64	8.40	7.72	7.07	6.35	5.83	5.41	5.70 / 9.14		
GHLC-24	12.16	11.96	9.62	8.27	7.70	7.14	6.35	5.89	5.46	5.64 / 9.23		
GHLC-25	11.95	11.74	9.49	8.02	7.61	7.18	6.41	5.91	5.48	5.51 / 9.22		
GHLC-26	11.68	11.68	9.26	8.15	7.42	7.05	6.41	5.84	5.38	5.39 / 8.83		
GHLC-27	10.61	10.61	8.90	7.90	7.45	6.83	6.43	5.78	5.48	5.16 / 8.97		
GHLC-28	11.53	11.53	9.22	7.89	7.43	7.04	6.45	5.82	5.46	5.41 / 9.01		
GHLC-29	10.51	10.51	8.67	7.91	7.43	6.78	6.44	5.83	5.48	5.18 / 8.97		
GHLC-30	10.38	10.29	8.26	7.95	7.40	6.69	6.37	5.80	5.52	5.26 / 9.02		
GHLC-31	10.19	10.10	8.15	7.79	7.22	6.60	6.28	5.73	5.46	4.98 / 8.81		
GHLC-32	10.09	9.72	8.04	7.59	7.15	6.65	6.23	5.67	5.48	4.92 / 8.70		
GHLC-33	10.39	10.35	8.33	7.85	7.27	6.62	6.29	5.72	5.47	5.10 / 8.85		
GHLC-34	10.33	10.12	8.03	7.70	7.11	6.59	6.19	5.62	5.49	5.01 / 8.63		
GHLC-35	10.34	10.33	8.08	7.72	7.11	6.59	6.21	5.61	5.46	5.08 / 8.65		
GHLC-36	11.18	10.70	8.53	7.94	7.42	6.76	6.35	5.77	5.52	5.27 / 8.86		
GHLC-37	11.05	10.54	8.34	7.88	7.32	6.73	6.29	5.72	5.49	5.10 / 8.76		
GHLC-38	11.68	10.83	8.75	8.02	7.58	6.86	6.41	5.78	5.49	5.31 / 8.92		
GHLC-39	11.45	10.64	8.42	7.95	7.46	6.76	6.31	5.69	5.50	5.27 / 8.81		
GHLC-40	12.03	11.33	8.95	8.13	7.62	6.94	6.43	5.83	5.50	5.65 / 9.10		
GHLC-41	11.46	10.78	8.51	8.00	7.47	6.76	6.33	5.69	5.53	5.35 / 8.82		
GHLC-42	11.59	10.99	8.92	8.22	7.69	6.97	6.39	5.75	5.56	5.71 / 9.04		
GHLC-43	12.14	11.59	9.37	8.37	7.74	7.10	6.54	5.83	5.59	6.00 / 9.22		
GHLC-44	12.60	12.39	9.99	8.68	7.99	7.31	6.54	5.96	5.62	6.38 / 9.54		
GHLC-45	12.77	12.05	9.70	8.54	7.84	7.18	6.48	5.87	5.58	6.22 / 9.33		
GHLC-46	12.33	12.03	9.88	8.58	7.87	7.22	6.51	5.91	5.61	6.25 / 9.34		
GHLC-47	12.62	12.16	9.86	8.61	7.91	7.21	6.55	5.88	5.55	6.23 / 9.28		
GHLC-48	12.07	11.45	9.10	8.23	7.79	6.91	6.41	5.75	5.56	5.66 / 8.88		
GHLC-49	11.98	11.47	9.09	8.20	7.80	6.90	6.42	5.73	5.55	5.71 / 8.83		
GHLC-50	12.37	12.14	9.77	8.59	7.91	7.17	6.51	5.83	5.59	6.19 / 9.18		
GHLC-51	12.54	11.67	9.20	8.31	7.89	6.97	6.46	5.71	5.54	5.94 / 8.87		
GHLC-52	12.18	11.29	8.98	8.20	7.82	6.79	6.32	5.72	5.54	5.68 / 8.68		
GHLC-53	11.82	11.52	9.12	8.33	7.90	6.90	6.40	5.77	5.58	5.92 / 8.79		
JHF-S1	12.25	12.25	10.41	9.19	7.77	6.80	6.41	5.53	5.38	6.35 / 9.44		
JHF-S2	12.25	12.25	10.24	9.03	7.74	6.84	6.47	5.53	5.38	6.34 / 9.25		
JHF-S3	12.27	12.27	10.26	9.01	7.78	6.84	6.45	5.56	5.37	6.35 / 9.15		
JHF-S4	12.18	12.18	9.88	8.70	7.70	6.82	6.47	5.65	5.32	6.04 / 8.99		
JHF-S5	12.02	12.02	9.49	8.54	7.61	6.71	6.39	5.72	5.27	5.81 / 8.81		
JHF-S6	12.08	12.08	9.56	8.55	7.65	6.74	6.39	5.72	5.28	5.86 / 8.78		
JHF-S7	12.10	12.10	9.52	8.55	7.67	6.72	6.35	5.71	5.24	5.84 / 8.73		
JHF-S8	11.67	11.21	8.95	8.28	7.35	6.49	6.11	5.75	5.21	5.47 / 8.29		
JHF-S9	11.70	11.20	8.95	8.30	7.33	6.49	6.16	5.73	5.21	5.48 / 8.30		
JHF-S10	11.10	10.76	8.71	7.97	7.36	6.84	6.21	5.72	5.35	5.35 / 8.38		
JHF-S11	11.65	11.03	9.10	8.16	7.61	7.05	6.29	5.86	5.49	5.70 / 8.91		
JHF-S12	11.86	11.13	9.21	8.19	7.67	7.10	6.38	5.89	5.58	5.83 / 8.99		
JHF-S13	7.63	7.63	7.33	6.93	6.16	5.15	4.85	4.45	3.78	2.84 / 8.49		
JHF-S14	7.70	7.70	7.31	6.90	6.23	5.15	4.83	4.41	3.78	2.83 / 8.32		
JHF-S15	7.75	7.75	7.42	6.91	6.25	5.22	4.88	4.44	3.78	2.82 / 8.28		
JHF-S16	8.14	8.14	7.77	7.06	6.40	5.56	5.01	4.49	3.91	3.17 / 8.29		

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-S17	8.12	8.12	7.75	7.04	6.34	5.55	4.97	4.37	3.96	3.12 / 8.16
JHF-S18	8.15	8.15	7.77	7.08	6.40	5.56	4.98	4.29	3.94	3.12 / 8.07
GHLC-S1	11.83	11.83	10.38	8.91	7.49	6.92	6.36	5.44	5.02	6.83 / 10.12
GHLC-S2	11.70	11.70	10.40	8.84	7.51	6.96	6.36	5.40	4.99	6.82 / 10.14
GHLC-S3	11.88	11.88	10.50	8.92	7.53	6.78	6.39	5.37	5.01	6.88 / 10.10
GHLC-S4	11.83	11.83	10.60	8.87	7.60	6.65	6.41	5.48	5.05	6.68 / 10.12
GHLC-S5	11.85	11.85	10.44	8.84	7.54	6.61	6.42	5.47	5.06	6.64 / 9.99
GHLC-S6	12.14	12.14	10.45	9.13	8.01	6.67	6.45	5.56	5.21	6.55 / 9.73
GHLC-S7	12.08	12.08	10.50	9.12	7.88	6.68	6.43	5.51	5.20	6.60 / 9.72
GHLC-S8	12.08	12.08	10.44	9.08	8.06	6.68	6.41	5.53	5.23	6.56 / 9.69
GHLC-S9	12.12	12.12	10.41	9.08	7.96	6.70	6.44	5.48	5.24	6.56 / 9.65
GHLC-S10	12.09	12.09	10.36	9.08	7.82	6.74	6.41	5.51	5.26	6.53 / 9.59

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。