

P S J 予測統計値
(中央値)

2010年 8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：みずほ、日興コーディアル、野村、三菱UFJ銀行、ゴールドマン・サックス、住友銀行、三菱UFJ銀行、クレディスイス、ドイツ、JP銀行、パナソニック・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	13.59	13.01	11.21	9.74	9.17	8.05	7.45	7.17	6.78	6.83 / 11.15		
JHF-2	13.92	12.88	11.20	9.98	9.18	8.07	7.44	7.18	6.76	6.79 / 11.13		
JHF-3	13.96	12.79	11.33	10.00	9.19	8.08	7.49	7.22	6.76	7.05 / 11.28		
JHF-4	13.64	13.36	11.50	10.11	9.32	8.20	7.46	7.21	6.78	7.22 / 11.22		
JHF-5	13.91	13.39	11.88	10.29	9.33	8.18	7.54	7.23	6.84	7.55 / 11.66		
JHF-6	14.42	13.45	11.69	10.13	9.31	8.31	7.59	7.21	6.77	7.13 / 11.44		
JHF-7	13.90	12.52	10.85	9.60	8.87	8.10	7.59	7.11	6.71	6.39 / 10.95		
JHF-8	14.48	12.94	11.58	10.01	9.22	8.27	7.55	7.25	6.74	7.05 / 11.41		
JHF-9	13.70	12.78	11.01	9.69	8.88	8.02	7.50	7.12	6.68	6.46 / 11.01		
JHF-10	13.21	12.00	10.38	9.39	8.54	8.06	7.47	7.02	6.68	6.04 / 10.70		
JHF-11	13.56	12.77	10.98	9.70	8.88	8.18	7.52	7.06	6.69	6.34 / 11.20		
JHF-12	13.61	12.59	10.78	9.61	8.79	8.17	7.53	7.02	6.72	6.38 / 11.07		
JHF-13	13.81	12.46	10.61	9.54	8.69	8.10	7.55	6.98	6.69	6.35 / 11.14		
JHF-14	12.64	12.07	10.28	9.37	8.49	7.99	7.51	7.00	6.68	6.24 / 10.82		
JHF-15	14.11	13.78	11.74	10.01	9.10	8.25	7.67	7.22	6.78	7.46 / 11.83		
JHF-16	14.57	13.79	12.27	10.26	9.28	8.50	7.70	7.32	6.84	8.01 / 12.22		
JHF-17	14.13	13.82	11.93	10.01	9.19	8.35	7.72	7.17	6.80	7.39 / 12.01		
JHF-18	14.02	13.54	11.46	9.89	8.93	8.25	7.66	7.13	6.75	7.17 / 11.69		
JHF-19	13.43	12.74	10.60	9.50	8.67	7.97	7.54	7.11	6.70	6.61 / 10.94		
JHF-20	13.48	12.83	10.74	9.55	8.75	7.99	7.56	7.13	6.71	6.73 / 11.09		
JHF-21	13.83	13.15	11.09	9.68	8.91	8.09	7.64	7.15	6.73	6.96 / 11.45		
JHF-22	13.80	13.11	11.10	9.67	8.88	8.07	7.64	7.13	6.75	7.13 / 11.58		
JHF-23	14.46	13.81	11.77	9.94	9.11	8.14	7.71	7.13	6.79	7.70 / 12.10		
JHF-24	14.03	13.53	11.49	9.77	8.98	8.14	7.71	7.16	6.78	7.23 / 11.96		
JHF-25	14.08	13.59	11.31	9.77	8.89	8.13	7.69	7.19	6.79	7.22 / 11.84		
JHF-26	14.21	13.92	11.63	9.98	8.94	8.20	7.74	7.06	6.79	7.84 / 11.90		
JHF-27	13.87	13.84	11.13	9.83	8.84	8.15	7.70	7.25	6.80	7.16 / 11.70		
JHF-28	13.23	13.20	10.49	9.45	8.57	8.00	7.68	7.11	6.78	6.62 / 11.11		
JHF-29	13.10	12.94	10.42	9.36	8.52	7.97	7.68	7.09	6.80	6.50 / 10.91		
JHF-30	12.69	12.45	10.23	9.23	8.44	7.95	7.68	7.05	6.82	6.49 / 10.63		
JHF-31	12.62	12.13	9.97	9.12	8.38	7.98	7.63	7.04	6.83	6.38 / 10.46		
JHF-32	12.93	12.55	10.26	9.25	8.49	8.01	7.74	7.12	6.88	6.46 / 10.83		
JHF-33	12.57	12.02	9.85	9.06	8.37	8.02	7.65	7.09	6.88	6.36 / 10.54		
JHF-34	12.65	12.09	9.91	9.08	8.44	8.05	7.68	7.12	6.92	6.28 / 10.73		
JHF-35	10.67	10.35	9.05	8.45	8.03	7.81	7.35	7.05	6.88	5.87 / 9.66		
JHF-36	10.40	10.10	8.84	8.40	8.00	7.81	7.34	7.06	6.89	5.81 / 9.58		
JHF-37	10.41	10.13	8.87	8.41	8.01	7.82	7.37	7.10	6.94	5.81 / 9.64		
JHF-38	10.16	9.90	8.76	8.30	7.97	7.81	7.37	7.11	6.95	5.72 / 9.62		
JHF-39	9.83	9.68	8.59	8.16	7.80	7.68	7.33	7.09	6.94	5.57 / 9.57		
GHLC-1	12.52	12.52	11.87	10.40	8.81	6.91	6.51	5.65	5.07	5.16 / 10.76		
GHLC-2	12.56	12.56	12.02	10.47	8.45	6.83	6.55	5.65	5.04	5.48 / 10.55		
GHLC-3	12.71	12.71	12.06	10.40	8.25	6.91	6.61	5.49	5.03	5.67 / 10.26		
GHLC-4	12.50	12.50	11.80	9.98	8.91	6.98	6.50	5.54	5.05	6.03 / 10.53		
GHLC-5	12.60	12.60	11.91	10.02	8.36	6.95	6.55	5.62	5.07	5.98 / 10.48		
GHLC-6	12.78	12.78	11.68	9.87	8.55	7.17	6.59	5.62	5.07	6.29 / 10.23		
GHLC-7	12.85	12.85	11.82	9.97	8.77	7.30	6.59	5.61	5.08	6.20 / 9.86		
GHLC-8	12.89	12.89	11.73	9.84	8.71	7.28	6.58	5.61	5.10	6.37 / 9.95		
GHLC-9	12.97	12.97	11.58	9.64	8.42	7.12	6.50	5.59	5.12	6.37 / 9.76		
GHLC-10	12.78	12.78	11.25	9.50	8.09	7.03	6.41	5.52	5.21	6.49 / 9.64		
GHLC-11	12.42	12.42	10.73	9.19	7.95	6.91	6.30	5.45	5.31	6.27 / 9.78		
GHLC-12	12.24	12.24	10.27	8.95	7.97	6.93	6.22	5.45	5.36	6.11 / 9.23		

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-13	12.30	12.30	10.45	9.06	7.95	6.99	6.26	5.48	5.36	5.96 / 9.68		
GHLC-14	12.41	12.41	10.59	9.13	7.98	7.02	6.29	5.50	5.36	6.14 / 9.35		
GHLC-15	12.26	12.26	10.38	9.04	7.90	6.94	6.29	5.50	5.43	6.01 / 9.36		
GHLC-16	12.20	12.20	10.30	9.01	7.91	6.94	6.25	5.52	5.39	6.08 / 9.40		
GHLC-17	12.24	12.24	10.40	9.02	7.97	6.97	6.27	5.53	5.43	5.96 / 9.29		
GHLC-18	12.18	12.18	10.34	8.97	7.92	7.04	6.30	5.59	5.47	6.10 / 9.15		
GHLC-19	12.05	12.05	10.11	8.85	7.84	7.01	6.28	5.60	5.41	6.07 / 9.05		
GHLC-20	11.99	11.99	10.04	8.86	7.88	7.02	6.40	5.71	5.42	5.88 / 9.13		
GHLC-21	11.96	11.96	10.02	8.88	7.87	7.08	6.40	5.79	5.47	5.96 / 9.25		
GHLC-22	12.17	12.17	10.32	9.05	7.94	7.16	6.41	5.73	5.53	6.06 / 9.48		
GHLC-23	12.18	12.18	10.27	9.05	7.86	7.15	6.44	5.80	5.52	6.06 / 9.49		
GHLC-24	12.06	12.06	10.18	8.99	7.86	7.18	6.50	5.85	5.56	5.97 / 9.59		
GHLC-25	11.89	11.89	9.95	8.79	7.78	7.20	6.51	5.94	5.53	5.95 / 9.59		
GHLC-26	11.62	11.62	9.60	8.65	7.70	7.10	6.47	5.82	5.42	5.84 / 9.14		
GHLC-27	10.55	10.55	9.22	8.00	7.42	7.02	6.43	5.90	5.51	5.34 / 9.26		
GHLC-28	11.47	11.47	9.57	8.42	7.63	7.13	6.41	5.90	5.50	5.66 / 9.31		
GHLC-29	10.45	10.45	9.21	8.00	7.36	6.98	6.41	5.91	5.56	5.35 / 9.25		
GHLC-30	10.24	10.24	9.14	8.07	7.39	6.96	6.37	5.93	5.60	5.42 / 9.29		
GHLC-31	10.03	10.03	8.93	7.92	7.44	6.81	6.46	5.84	5.51	5.23 / 9.08		
GHLC-32	9.67	9.67	8.79	7.84	7.39	6.76	6.42	5.84	5.53	5.20 / 8.95		
GHLC-33	10.29	10.29	8.99	7.94	7.46	6.84	6.49	5.89	5.55	5.26 / 9.15		
GHLC-34	10.05	10.05	8.72	7.83	7.34	6.75	6.39	5.85	5.51	5.15 / 8.89		
GHLC-35	10.29	10.29	8.79	7.88	7.35	6.79	6.38	5.85	5.51	5.24 / 8.93		
GHLC-36	10.74	10.74	9.11	8.06	7.59	7.01	6.45	5.92	5.59	5.48 / 9.16		
GHLC-37	10.58	10.58	8.99	8.01	7.51	6.95	6.47	5.88	5.54	5.37 / 9.05		
GHLC-38	10.96	10.86	9.24	8.17	7.64	7.12	6.52	5.91	5.56	5.65 / 9.25		
GHLC-39	10.86	10.68	9.10	8.05	7.56	7.02	6.52	5.90	5.57	5.47 / 9.09		
GHLC-40	11.37	11.37	9.49	8.34	7.73	7.19	6.53	5.98	5.60	5.94 / 9.40		
GHLC-41	10.92	10.81	9.14	8.13	7.59	7.02	6.55	5.94	5.59	5.58 / 9.14		
GHLC-42	11.33	11.15	9.50	8.33	7.78	7.18	6.49	5.99	5.61	6.03 / 9.39		
GHLC-43	11.76	11.63	10.03	8.52	7.92	7.34	6.63	6.05	5.66	6.41 / 9.62		
GHLC-44	12.61	12.41	10.91	8.86	8.12	7.48	6.65	6.13	5.70	6.75 / 9.95		
GHLC-45	12.49	12.17	10.45	8.69	8.02	7.45	6.68	6.06	5.65	6.56 / 9.74		
GHLC-46	12.68	12.30	10.59	8.76	8.05	7.47	6.84	6.09	5.68	6.60 / 9.75		
GHLC-47	12.48	12.16	10.56	8.76	8.06	7.51	6.82	6.07	5.67	6.60 / 9.72		
GHLC-48	12.28	11.51	9.59	8.45	7.78	7.21	6.63	5.98	5.60	5.98 / 9.28		
GHLC-49	12.13	11.51	9.56	8.44	7.76	7.21	6.62	5.97	5.60	6.17 / 9.26		
GHLC-50	12.70	12.12	10.52	8.77	8.09	7.51	6.87	6.05	5.67	6.55 / 9.84		
GHLC-51	12.32	11.71	9.86	8.55	7.84	7.30	6.68	5.98	5.59	6.26 / 9.40		
GHLC-52	12.00	11.25	9.43	8.40	7.84	7.06	6.54	5.93	5.61	5.98 / 9.15		
GHLC-53	12.56	11.53	9.71	8.55	7.80	7.17	6.64	6.01	5.63	6.23 / 9.43		
JHF-S1	12.22	12.22	10.84	9.78	8.47	7.03	6.47	5.60	5.30	6.90 / 9.90		
JHF-S2	12.16	12.16	10.75	9.73	8.47	7.10	6.47	5.60	5.33	6.88 / 9.69		
JHF-S3	12.20	12.20	10.78	9.65	8.35	7.17	6.48	5.62	5.35	6.90 / 9.77		
JHF-S4	12.07	12.07	10.42	9.10	8.17	6.94	6.37	5.64	5.46	6.50 / 9.50		
JHF-S5	11.92	11.92	10.06	8.94	8.06	6.86	6.27	5.67	5.36	6.24 / 9.22		
JHF-S6	11.98	11.98	10.15	9.01	8.10	6.86	6.29	5.67	5.40	6.30 / 9.25		
JHF-S7	12.00	12.00	10.08	9.00	8.07	6.88	6.31	5.66	5.38	6.27 / 9.19		
JHF-S8	11.67	11.67	9.31	8.61	7.68	6.74	6.14	5.82	5.31	5.82 / 8.65		
JHF-S9	11.69	11.69	9.28	8.55	7.67	6.75	6.12	5.84	5.32	5.83 / 8.66		
JHF-S10	11.14	11.14	9.06	8.34	7.56	7.01	6.29	5.88	5.41	5.63 / 8.67		
JHF-S11	11.62	11.24	9.47	8.60	7.66	7.29	6.40	6.01	5.55	6.01 / 9.29		
JHF-S12	11.82	11.48	9.57	8.68	7.81	7.24	6.59	6.06	5.63	6.16 / 9.42		
JHF-S13	7.57	7.57	7.53	7.11	6.38	5.47	4.84	4.49	3.77	2.84 / 8.84		
JHF-S14	7.65	7.65	7.60	7.16	6.38	5.48	4.87	4.45	3.78	2.82 / 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-S15	7.68	7.68	7.63	7.16	6.44	5.55	4.90	4.46	3.78	2.81 / 8.59	
JHF-S16	8.02	8.02	7.80	7.25	6.55	5.61	5.06	4.60	3.92	3.17 / 8.67	
JHF-S17	8.01	8.01	7.79	7.23	6.52	5.61	5.02	4.61	3.95	3.12 / 8.52	
JHF-S18	8.02	8.02	7.80	7.27	6.55	5.61	5.03	4.57	3.92	3.11 / 8.45	
GHLC-S1	11.82	11.82	11.03	9.54	8.00	6.75	6.36	5.58	5.06	6.63 / 10.57	
GHLC-S2	11.77	11.77	10.98	9.43	7.81	6.72	6.34	5.55	5.05	6.72 / 10.67	
GHLC-S3	11.87	11.87	11.13	9.54	8.11	6.68	6.36	5.54	5.08	6.68 / 10.64	
GHLC-S4	11.87	11.87	11.09	9.43	8.21	6.70	6.42	5.64	5.08	6.78 / 10.65	
GHLC-S5	11.78	11.78	10.97	9.42	8.11	6.71	6.41	5.63	5.06	6.86 / 10.53	
GHLC-S6	12.08	12.08	10.94	9.65	8.46	7.25	6.42	5.66	5.14	6.98 / 10.19	
GHLC-S7	12.05	12.05	10.95	9.62	8.45	7.00	6.43	5.65	5.16	7.00 / 10.18	
GHLC-S8	11.98	11.98	10.92	9.61	8.42	7.16	6.42	5.63	5.17	7.07 / 10.16	
GHLC-S9	12.02	12.02	10.95	9.65	8.40	7.09	6.42	5.62	5.17	7.07 / 10.16	
GHLC-S10	12.05	12.05	10.84	9.63	8.45	7.09	6.40	5.63	5.20	7.05 / 10.09	

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。