

PSJ 予測統計値
(平均値)

2010年 8月 16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、リソリンチ日本、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	13.49	12.75	11.53	10.17	9.08	8.22	7.59	6.88	6.58	7.12 / 11.44		
JHF-2	13.47	12.70	11.51	10.16	9.05	8.20	7.56	6.88	6.58	7.08 / 11.42		
JHF-3	13.60	12.87	11.63	10.25	9.13	8.25	7.61	6.91	6.61	7.34 / 11.59		
JHF-4	13.73	13.06	11.76	10.39	9.19	8.28	7.62	6.91	6.60	7.59 / 11.55		
JHF-5	14.17	13.39	12.14	10.62	9.39	8.43	7.76	6.96	6.64	7.92 / 11.95		
JHF-6	13.93	13.23	11.93	10.42	9.24	8.33	7.70	6.94	6.61	7.50 / 11.75		
JHF-7	13.14	12.50	11.21	9.91	8.85	8.08	7.49	6.86	6.57	6.60 / 11.24		
JHF-8	13.91	13.12	11.87	10.38	9.19	8.31	7.64	6.93	6.62	7.35 / 11.71		
JHF-9	13.32	12.62	11.35	9.97	8.91	8.14	7.54	6.89	6.60	6.71 / 11.31		
JHF-10	12.75	12.13	10.90	9.61	8.67	7.97	7.39	6.82	6.56	6.23 / 11.01		
JHF-11	13.26	12.62	11.35	10.00	8.91	8.14	7.52	6.89	6.61	6.62 / 11.49		
JHF-12	13.16	12.52	11.24	9.91	8.84	8.08	7.48	6.87	6.60	6.62 / 11.35		
JHF-13	13.02	12.36	11.12	9.84	8.80	8.06	7.47	6.88	6.61	6.52 / 11.45		
JHF-14	12.74	12.07	10.87	9.61	8.66	7.95	7.39	6.85	6.60	6.44 / 11.09		
JHF-15	14.13	13.41	12.09	10.57	9.29	8.37	7.69	6.98	6.67	7.78 / 12.15		
JHF-16	14.70	13.95	12.59	10.95	9.60	8.56	7.83	7.02	6.70	8.17 / 12.54		
JHF-17	14.31	13.58	12.22	10.66	9.37	8.45	7.78	7.03	6.72	7.77 / 12.32		
JHF-18	14.04	13.31	11.96	10.40	9.20	8.34	7.68	6.99	6.68	7.54 / 12.00		
JHF-19	13.20	12.54	11.20	9.89	8.82	8.09	7.51	6.92	6.65	6.81 / 11.21		
JHF-20	13.33	12.69	11.38	9.93	8.89	8.15	7.55	6.95	6.67	7.00 / 11.37		
JHF-21	13.81	13.10	11.74	10.20	9.06	8.26	7.63	6.98	6.70	7.29 / 11.77		
JHF-22	13.89	13.16	11.77	10.27	9.08	8.25	7.65	7.00	6.72	7.40 / 11.88		
JHF-23	14.65	13.89	12.37	10.74	9.41	8.45	7.79	7.07	6.76	8.05 / 12.40		
JHF-24	14.29	13.56	12.06	10.49	9.24	8.38	7.74	7.05	6.76	7.54 / 12.27		
JHF-25	14.27	13.54	12.05	10.44	9.22	8.36	7.72	7.05	6.76	7.54 / 12.15		
JHF-26	14.76	13.97	12.40	10.73	9.40	8.48	7.79	7.08	6.77	8.15 / 12.24		
JHF-27	14.33	13.58	12.04	10.42	9.22	8.39	7.73	7.08	6.78	7.45 / 12.01		
JHF-28	13.51	12.77	11.29	9.91	8.87	8.17	7.59	7.02	6.75	6.83 / 11.39		
JHF-29	13.29	12.57	11.15	9.75	8.80	8.11	7.56	7.03	6.77	6.70 / 11.16		
JHF-30	12.95	12.28	10.87	9.53	8.69	8.05	7.53	7.03	6.76	6.64 / 10.90		
JHF-31	12.69	12.07	10.66	9.45	8.62	7.99	7.50	7.02	6.77	6.55 / 10.72		
JHF-32	13.07	12.37	10.92	9.63	8.76	8.11	7.59	7.09	6.83	6.64 / 11.08		
JHF-33	12.67	12.03	10.65	9.45	8.63	8.03	7.53	7.06	6.82	6.50 / 10.78		
JHF-34	12.74	12.13	10.72	9.50	8.69	8.06	7.58	7.11	6.86	6.49 / 10.97		
JHF-35	11.51	10.87	9.65	8.79	8.18	7.71	7.36	7.00	6.78	6.09 / 9.70		
JHF-36	11.30	10.75	9.52	8.68	8.11	7.67	7.34	7.00	6.79	6.05 / 9.60		
JHF-37	11.38	10.79	9.53	8.64	8.12	7.69	7.36	7.01	6.80	6.04 / 9.67		
JHF-38	11.15	10.53	9.38	8.54	8.04	7.64	7.33	7.00	6.80	5.95 / 9.66		
JHF-39	10.83	10.21	9.17	8.38	7.94	7.59	7.31	7.00	6.81	5.79 / 9.60		
GHLC-1	12.36	11.79	11.21	10.14	8.74	7.43	6.45	5.33	4.83	5.14 / 11.11		
GHLC-2	12.44	11.83	11.29	10.12	8.73	7.44	6.46	5.39	4.91	5.44 / 10.83		
GHLC-3	12.41	11.84	11.22	10.09	8.66	7.37	6.43	5.40	4.96	5.66 / 10.56		
GHLC-4	12.56	11.98	11.39	10.15	8.70	7.40	6.48	5.49	5.05	6.01 / 10.78		
GHLC-5	12.55	12.02	11.37	10.18	8.68	7.41	6.51	5.55	5.13	5.95 / 10.79		
GHLC-6	12.61	12.08	11.46	10.16	8.69	7.45	6.55	5.61	5.20	6.25 / 10.52		
GHLC-7	12.60	12.03	11.42	10.16	8.61	7.38	6.50	5.58	5.18	6.18 / 10.13		
GHLC-8	12.56	12.06	11.39	10.08	8.59	7.39	6.52	5.62	5.23	6.36 / 10.22		
GHLC-9	12.43	11.92	11.25	9.91	8.41	7.25	6.45	5.59	5.22	6.36 / 10.06		
GHLC-10	12.32	11.80	11.11	9.73	8.26	7.15	6.40	5.57	5.23	6.48 / 9.82		
GHLC-11	12.19	11.68	10.92	9.51	8.09	7.03	6.36	5.60	5.28	6.56 / 10.04		
GHLC-12	11.98	11.52	10.68	9.27	7.88	6.94	6.30	5.59	5.31	6.27 / 9.50		

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	12.05	11.59	10.79	9.36	7.96	6.98	6.33	5.60	5.32	6.10 / 9.94		
GHLC-14	12.09	11.64	10.85	9.37	8.04	7.03	6.36	5.61	5.32	6.40 / 9.71		
GHLC-15	12.11	11.55	10.77	9.35	7.97	6.99	6.35	5.60	5.31	6.31 / 9.63		
GHLC-16	12.05	11.57	10.71	9.32	7.94	6.98	6.35	5.60	5.32	6.21 / 9.66		
GHLC-17	12.09	11.60	10.82	9.32	7.96	7.02	6.37	5.64	5.36	6.08 / 9.63		
GHLC-18	12.09	11.60	10.73	9.30	7.97	7.01	6.39	5.66	5.38	6.41 / 9.43		
GHLC-19	12.03	11.48	10.65	9.16	7.91	6.97	6.35	5.64	5.37	6.33 / 9.31		
GHLC-20	12.07	11.58	10.68	9.22	7.96	7.08	6.42	5.71	5.44	6.13 / 9.44		
GHLC-21	12.12	11.58	10.69	9.20	7.97	7.10	6.44	5.74	5.47	6.19 / 9.45		
GHLC-22	12.22	11.67	10.82	9.31	8.04	7.12	6.47	5.75	5.48	6.31 / 9.77		
GHLC-23	12.26	11.74	10.82	9.32	8.07	7.16	6.49	5.78	5.49	6.30 / 9.73		
GHLC-24	12.22	11.72	10.81	9.33	8.07	7.20	6.53	5.82	5.54	6.18 / 9.75		
GHLC-25	12.10	11.59	10.58	9.13	7.99	7.15	6.54	5.83	5.55	6.14 / 9.69		
GHLC-26	11.91	11.35	10.44	9.01	7.83	7.03	6.41	5.76	5.50	6.02 / 9.21		
GHLC-27	11.19	10.65	9.70	8.53	7.58	6.89	6.32	5.76	5.52	5.50 / 9.34		
GHLC-28	11.82	11.33	10.26	8.89	7.79	7.03	6.41	5.78	5.52	5.84 / 9.43		
GHLC-29	11.11	10.59	9.62	8.43	7.56	6.86	6.30	5.76	5.52	5.48 / 9.34		
GHLC-30	10.98	10.42	9.47	8.38	7.53	6.83	6.28	5.76	5.52	5.58 / 9.41		
GHLC-31	10.80	10.30	9.33	8.28	7.42	6.76	6.24	5.73	5.50	5.39 / 9.18		
GHLC-32	10.55	10.07	9.13	8.16	7.34	6.72	6.22	5.74	5.52	5.30 / 9.06		
GHLC-33	10.96	10.39	9.40	8.31	7.47	6.80	6.26	5.75	5.51	5.40 / 9.23		
GHLC-34	10.64	10.09	9.12	8.13	7.35	6.70	6.21	5.74	5.51	5.29 / 9.00		
GHLC-35	10.77	10.27	9.28	8.23	7.40	6.74	6.24	5.75	5.51	5.36 / 9.01		
GHLC-36	11.31	10.71	9.69	8.54	7.63	6.89	6.35	5.80	5.55	5.63 / 9.28		
GHLC-37	11.14	10.59	9.56	8.43	7.55	6.85	6.31	5.77	5.53	5.54 / 9.18		
GHLC-38	11.53	10.98	9.87	8.70	7.73	6.99	6.40	5.81	5.55	5.85 / 9.39		
GHLC-39	11.34	10.77	9.74	8.59	7.62	6.90	6.33	5.78	5.53	5.66 / 9.20		
GHLC-40	11.87	11.26	10.20	8.91	7.87	7.07	6.46	5.83	5.56	6.16 / 9.57		
GHLC-41	11.42	10.84	9.79	8.63	7.67	6.95	6.38	5.80	5.54	5.76 / 9.29		
GHLC-42	11.87	11.26	10.16	8.90	7.87	7.08	6.45	5.83	5.56	6.29 / 9.57		
GHLC-43	12.30	11.66	10.52	9.19	8.08	7.23	6.57	5.88	5.59	6.63 / 9.80		
GHLC-44	12.98	12.28	11.14	9.65	8.44	7.47	6.72	5.95	5.64	7.02 / 10.15		
GHLC-45	12.71	12.04	10.90	9.42	8.26	7.34	6.64	5.91	5.60	6.81 / 9.93		
GHLC-46	12.85	12.20	10.98	9.55	8.32	7.38	6.69	5.92	5.60	6.87 / 10.07		
GHLC-47	12.96	12.27	11.05	9.58	8.34	7.40	6.73	5.94	5.62	6.86 / 10.04		
GHLC-48	12.29	11.58	10.43	9.08	7.97	7.15	6.57	5.86	5.58	6.27 / 9.54		
GHLC-49	12.32	11.63	10.42	9.08	7.98	7.16	6.56	5.88	5.59	6.38 / 9.56		
GHLC-50	12.98	12.27	11.04	9.56	8.35	7.41	6.73	5.95	5.63	6.81 / 10.16		
GHLC-51	12.53	11.91	10.64	9.25	8.08	7.22	6.59	5.89	5.59	6.51 / 9.72		
GHLC-52	12.22	11.52	10.34	8.98	7.92	7.11	6.50	5.85	5.57	6.27 / 9.44		
GHLC-53	12.43	11.79	10.54	9.14	8.05	7.20	6.58	5.89	5.59	6.44 / 9.72		
JHF-S1	12.34	11.81	11.11	9.94	8.62	7.46	6.58	5.62	5.19	7.12 / 10.17		
JHF-S2	12.31	11.73	11.01	9.92	8.59	7.43	6.57	5.61	5.18	7.12 / 9.96		
JHF-S3	12.25	11.73	11.01	9.90	8.59	7.43	6.56	5.60	5.17	7.15 / 10.02		
JHF-S4	12.15	11.61	10.89	9.63	8.32	7.24	6.48	5.62	5.25	6.85 / 9.77		
JHF-S5	12.02	11.50	10.72	9.42	8.12	7.10	6.39	5.60	5.27	6.54 / 9.53		
JHF-S6	12.06	11.54	10.74	9.53	8.18	7.14	6.42	5.61	5.28	6.62 / 9.55		
JHF-S7	12.05	11.52	10.75	9.47	8.15	7.11	6.40	5.59	5.27	6.56 / 9.48		
JHF-S8	11.64	11.17	10.36	9.05	7.74	6.89	6.30	5.62	5.36	6.06 / 8.92		
JHF-S9	11.65	11.19	10.34	9.05	7.76	6.90	6.31	5.63	5.37	6.08 / 8.99		
JHF-S10	11.50	11.07	10.17	8.74	7.68	6.93	6.34	5.73	5.48	5.86 / 8.77		
JHF-S11	11.98	11.47	10.49	9.08	7.92	7.11	6.47	5.82	5.55	6.24 / 9.45		
JHF-S12	12.16	11.62	10.63	9.16	8.02	7.18	6.54	5.86	5.59	6.39 / 9.59		
JHF-S13	7.64	7.47	7.08	6.39	5.67	5.07	4.62	4.10	3.79	2.85 / 9.04		
JHF-S14	7.65	7.47	7.07	6.42	5.67	5.07	4.64	4.10	3.80	2.84 / 8.89		

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	
JHF-S15	7.61	7.41	7.04	6.39	5.64	5.04	4.61	4.07	3.77	2.82 / 8.84
JHF-S16	8.05	7.88	7.50	6.81	5.99	5.33	4.84	4.20	3.91	3.18 / 8.89
JHF-S17	8.07	7.85	7.45	6.72	5.98	5.31	4.82	4.18	3.91	3.13 / 8.72
JHF-S18	8.06	7.92	7.52	6.76	6.01	5.34	4.84	4.20	3.92	3.12 / 8.63
GHLC-S1	12.07	11.48	10.80	9.72	8.52	7.37	6.47	5.41	4.92	6.63 / 10.87
GHLC-S2	11.97	11.38	10.73	9.71	8.47	7.34	6.45	5.40	4.92	6.70 / 10.93
GHLC-S3	12.07	11.44	10.78	9.73	8.52	7.38	6.46	5.42	4.95	6.67 / 10.92
GHLC-S4	12.19	11.65	10.99	9.86	8.60	7.44	6.53	5.51	5.05	6.77 / 10.91
GHLC-S5	12.15	11.62	10.89	9.80	8.56	7.40	6.50	5.49	5.04	6.84 / 10.82
GHLC-S6	12.32	11.80	11.11	9.99	8.70	7.52	6.60	5.59	5.13	6.97 / 10.48
GHLC-S7	12.28	11.74	11.07	9.94	8.67	7.49	6.58	5.57	5.11	7.00 / 10.46
GHLC-S8	12.28	11.77	11.09	9.95	8.67	7.50	6.59	5.57	5.12	7.04 / 10.41
GHLC-S9	12.28	11.77	11.03	9.92	8.66	7.48	6.58	5.58	5.12	7.05 / 10.43
GHLC-S10	12.29	11.75	11.06	9.96	8.67	7.50	6.59	5.58	5.12	7.09 / 10.36

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。