

P S J 予測統計値  
(中央値)

2009年 10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、エイガン・スタンレー、クレディ・スイス、ドイツ、JPエムシー、UBS、メリル・リンチ日本、大和SMBC、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	12.85	12.57	10.13	9.10	8.58	7.86	7.31	6.64	6.51	6.72 / 11.55		
JHF-2	12.80	12.53	10.06	9.05	8.57	7.86	7.28	6.62	6.52	6.70 / 11.48		
JHF-3	13.01	12.97	10.18	9.12	8.61	7.88	7.33	6.64	6.54	6.82 / 11.68		
JHF-4	13.30	12.91	10.32	9.15	8.62	7.89	7.33	6.68	6.56	6.91 / 11.64		
JHF-5	13.50	13.38	10.61	9.30	8.66	7.97	7.43	6.79	6.56	7.00 / 12.08		
JHF-6	13.48	13.11	10.33	9.13	8.65	7.90	7.31	6.73	6.55	6.82 / 11.84		
JHF-7	12.44	12.28	9.66	8.79	8.32	7.70	7.21	6.68	6.55	6.57 / 11.35		
JHF-8	13.34	12.93	10.19	9.06	8.56	7.83	7.28	6.72	6.57	6.80 / 11.84		
JHF-9	12.69	12.57	9.88	8.83	8.14	7.60	7.22	6.67	6.58	6.67 / 11.45		
JHF-10	12.16	11.73	9.55	8.75	8.16	7.62	7.23	6.68	6.59	6.50 / 11.13		
JHF-11	12.65	12.57	9.85	8.87	8.29	7.69	7.29	6.74	6.61	6.72 / 11.69		
JHF-12	12.56	12.41	9.81	8.78	8.25	7.68	7.27	6.77	6.62	6.66 / 11.57		
JHF-13	12.36	12.24	9.87	8.78	8.17	7.64	7.29	6.78	6.65	6.68 / 11.68		
JHF-14	12.18	11.82	9.65	8.79	8.10	7.60	7.28	6.75	6.66	6.62 / 11.33		
JHF-15	13.90	13.52	10.46	9.31	8.46	7.83	7.40	6.93	6.69	7.20 / 12.44		
JHF-16	14.13	13.79	10.92	9.48	8.61	7.94	7.48	7.00	6.68	7.60 / 12.86		
JHF-17	13.95	13.03	10.63	9.46	8.48	7.86	7.44	6.96	6.70	7.30 / 12.69		
JHF-18	13.87	13.47	10.43	9.27	8.40	7.80	7.42	6.96	6.69	7.22 / 12.35		
JHF-19	12.84	12.58	10.07	8.93	8.16	7.66	7.35	6.87	6.70	6.90 / 11.53		
JHF-20	13.00	12.82	10.26	9.01	8.20	7.69	7.36	6.92	6.74	6.96 / 11.74		
JHF-21	13.60	13.17	10.42	9.20	8.31	7.78	7.44	6.99	6.75	7.15 / 12.18		
JHF-22	13.65	13.48	10.39	9.18	8.32	7.79	7.46	7.00	6.77	7.15 / 12.34		
JHF-23	14.44	14.17	10.77	9.49	8.53	7.88	7.55	7.14	6.77	7.40 / 12.86		
JHF-24	14.11	13.96	10.71	9.33	8.44	7.91	7.54	7.14	6.81	7.29 / 12.76		
JHF-25	14.23	14.01	10.52	9.30	8.41	7.94	7.54	7.15	6.81	7.23 / 12.60		
JHF-26	14.92	14.07	10.57	9.33	8.48	8.00	7.59	7.21	6.85	7.47 / 12.69		
JHF-27	14.57	14.07	10.48	9.24	8.42	8.02	7.58	7.21	6.85	7.26 / 12.51		
JHF-28	13.78	13.12	9.91	8.96	8.31	7.95	7.53	7.13	6.83	6.89 / 11.83		
JHF-29	13.63	12.82	9.83	8.86	8.30	7.93	7.51	7.11	6.86	6.73 / 11.58		
GHLC-1	12.67	12.67	11.04	8.72	7.24	6.01	5.11	4.73	4.43	5.65 / 10.68		
GHLC-2	12.90	12.90	11.03	8.71	7.12	5.90	5.23	4.83	4.52	5.69 / 10.56		
GHLC-3	12.97	12.97	10.88	8.83	7.22	5.97	5.15	4.93	4.61	5.66 / 10.47		
GHLC-4	12.91	12.91	10.55	8.64	7.08	5.90	5.41	5.16	4.77	5.72 / 10.54		
GHLC-5	12.91	12.91	10.66	8.63	7.20	5.97	5.49	5.18	4.89	5.38 / 10.55		
GHLC-6	13.26	13.18	11.47	8.65	7.75	7.02	6.08	5.08	4.93	5.65 / 10.45		
GHLC-7	13.37	13.00	11.47	8.63	7.70	6.99	6.17	5.04	4.85	5.62 / 10.44		
GHLC-8	13.42	13.25	11.60	8.68	7.73	7.03	6.19	5.11	4.92	5.57 / 10.34		
GHLC-9	13.58	12.99	11.34	8.53	7.66	6.94	6.11	5.17	4.91	5.33 / 10.17		
GHLC-10	13.25	12.63	11.16	8.41	7.55	6.89	6.08	5.22	4.96	5.37 / 10.01		
GHLC-11	13.13	12.39	10.63	8.24	7.45	6.78	5.96	5.27	5.02	5.12 / 9.74		
GHLC-12	12.67	11.97	10.17	8.05	7.27	6.65	5.99	5.35	5.12	5.28 / 9.52		
GHLC-13	12.53	12.20	10.31	8.18	7.35	6.72	6.12	5.37	5.21	5.38 / 9.62		
GHLC-14	12.93	12.23	10.41	8.21	7.39	6.76	6.00	5.36	5.09	5.20 / 9.68		
GHLC-15	12.76	12.19	10.31	8.16	7.33	6.70	6.00	5.37	5.11	5.25 / 9.63		
GHLC-16	12.76	12.19	10.23	8.12	7.34	6.68	6.01	5.38	5.14	5.31 / 9.57		
GHLC-17	12.53	12.08	10.27	8.14	7.36	6.70	6.10	5.39	5.23	5.31 / 9.55		
GHLC-18	12.52	12.14	9.99	8.13	7.36	6.70	6.09	5.42	5.28	5.27 / 9.45		
GHLC-19	12.43	12.03	9.94	8.08	7.28	6.66	6.08	5.43	5.31	5.36 / 9.44		
GHLC-20	12.36	11.97	9.85	8.06	7.29	6.67	6.19	5.56	5.40	5.42 / 9.39		
GHLC-21	12.15	11.99	9.68	8.07	7.31	6.69	6.23	5.62	5.41	5.49 / 9.36		
GHLC-22	12.31	12.24	9.85	8.22	7.44	6.78	6.12	5.58	5.47	5.58 / 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、野村、三菱UFJ、コールドマン・サクス、カカ・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、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-23	12.31	12.28	9.79	8.22	7.41	6.76	6.23	5.63	5.48	5.60 /	9.51
GHLC-24	12.28	12.11	9.64	8.20	7.42	6.78	6.26	5.67	5.44	5.65 /	9.45
GHLC-25	12.06	11.51	9.12	8.09	7.35	7.18	6.21	5.70	5.41	5.64 /	9.28
GHLC-26	11.63	11.50	9.20	7.86	7.35	6.86	6.06	5.64	5.39	5.41 /	9.12
GHLC-27	10.84	10.72	8.49	7.62	7.52	6.85	5.92	5.70	5.25	5.53 /	8.48
GHLC-28	11.58	11.53	8.74	7.82	7.43	6.92	6.08	5.72	5.33	5.50 /	8.94
GHLC-29	10.71	10.70	8.45	7.60	7.52	6.78	5.92	5.68	5.23	5.50 /	8.43
GHLC-30	10.27	10.24	8.41	7.56	7.52	6.68	5.93	5.66	5.22	5.52 /	8.41
GHLC-31	10.28	10.23	8.21	7.58	7.48	6.73	5.92	5.60	5.18	5.43 /	8.24
GHLC-32	9.88	9.88	8.03	7.62	7.38	6.59	5.94	5.54	5.16	5.42 /	8.11
GHLC-33	10.39	10.35	8.24	7.62	7.53	6.77	5.95	5.65	5.19	5.52 /	8.25
GHLC-34	10.18	10.18	7.99	7.66	7.32	6.62	5.97	5.57	5.20	5.42 /	8.04
GHLC-35	10.29	10.24	8.03	7.70	7.36	6.66	5.98	5.59	5.19	5.43 /	8.18
GHLC-36	10.60	10.58	8.33	7.68	7.54	6.72	5.98	5.72	5.23	5.55 /	8.65
GHLC-37	10.50	10.42	8.22	7.70	7.50	6.74	6.00	5.70	5.23	5.51 /	8.57
GHLC-38	10.83	10.78	8.45	7.72	7.67	6.85	6.01	5.79	5.26	5.62 /	8.95
GHLC-39	10.59	10.55	8.29	7.76	7.56	6.78	6.01	5.73	5.24	5.56 /	8.79
GHLC-40	11.33	11.09	8.69	7.75	7.72	6.93	6.02	5.83	5.30	5.68 /	9.18
GHLC-41	10.73	10.69	8.35	7.80	7.55	6.78	6.03	5.74	5.24	5.58 /	8.80
GHLC-42	11.12	11.07	8.67	7.78	7.76	6.91	6.05	5.82	5.30	5.71 /	9.17
GHLC-43	11.62	11.21	8.95	7.93	7.82	7.02	6.11	5.86	5.33	5.84 /	9.56
GHLC-44	12.46	12.41	9.41	8.30	7.82	7.19	6.24	5.92	5.43	6.06 /	10.25
GHLC-45	11.94	11.91	9.11	8.08	7.86	7.07	6.15	5.87	5.40	5.94 /	10.08
GHLC-46	12.14	12.07	9.21	8.14	7.84	7.07	6.16	5.87	5.41	5.98 /	10.32
GHLC-47	12.24	12.11	9.14	8.10	7.90	7.05	6.16	5.86	5.40	5.97 /	10.36
GHLC-48	11.54	11.10	8.64	7.95	7.58	6.80	6.13	5.78	5.35	5.74 /	9.70
GHLC-49	11.57	11.49	8.59	7.99	7.57	6.77	6.12	5.77	5.31	5.72 /	9.71
GHLC-50	12.32	12.19	9.08	8.10	7.86	6.97	6.21	5.83	5.43	5.96 /	10.43
GHLC-51	11.84	11.75	8.70	8.01	7.60	6.80	6.17	5.78	5.36	5.80 /	10.01
GHLC-52	11.42	11.21	8.47	8.05	7.58	6.79	6.16	5.76	5.37	5.73 /	9.55
GHLC-53	11.66	11.53	8.59	8.03	7.68	6.86	6.19	5.80	5.42	5.79 /	9.79
JHF-S1	13.05	12.49	10.87	8.63	7.52	6.61	6.29	5.37	4.81	5.52 /	10.12
JHF-S2	12.74	12.44	10.83	8.70	7.54	6.64	6.29	5.37	4.81	5.52 /	10.12
JHF-S3	13.04	12.43	10.79	8.63	7.56	6.66	6.31	5.39	4.83	5.54 /	10.09
JHF-S4	13.01	12.06	10.68	8.41	7.52	6.68	6.21	5.38	4.80	5.38 /	9.84
JHF-S5	12.88	11.70	10.44	8.23	7.26	6.61	6.12	5.33	4.85	5.28 /	9.66
JHF-S6	12.61	11.74	10.51	8.31	7.29	6.61	6.14	5.34	4.85	5.30 /	9.69
JHF-S7	12.32	11.78	10.43	8.19	7.26	6.64	6.09	5.34	4.87	5.08 /	9.65
JHF-S8	11.47	10.94	9.91	7.76	6.98	6.43	5.96	5.24	5.14	5.16 /	9.23
JHF-S9	11.54	11.46	9.83	7.77	7.01	6.44	5.96	5.26	5.15	5.16 /	9.25
JHF-S10	11.32	10.50	9.33	7.70	7.47	6.63	5.91	5.72	5.32	5.19 /	8.83
JHF-S11	11.60	11.19	9.63	7.78	7.50	6.56	6.04	5.82	5.35	5.51 /	9.12
JHF-S12	11.90	11.37	9.68	7.85	7.44	6.60	6.08	5.84	5.35	5.60 /	9.23
JHF-S13	7.90	7.39	7.39	6.95	6.19	5.22	4.73	4.09	3.09	2.80 /	7.56
JHF-S14	7.94	7.39	7.39	6.95	6.24	5.29	4.68	3.90	3.03	2.81 /	7.39
JHF-S15	7.96	7.41	7.41	6.95	6.25	5.35	4.72	3.89	3.05	2.81 /	7.41
JHF-S16	8.44	7.84	7.84	7.39	6.59	5.76	4.93	3.94	3.17	3.16 /	7.84
GHLC-S1	12.32	12.32	9.96	8.30	7.28	6.90	6.06	5.19	4.86	5.62 /	10.18
GHLC-S2	12.27	12.27	9.88	8.07	7.02	6.94	6.16	5.19	4.84	5.72 /	10.17
GHLC-S3	12.35	12.35	10.02	8.14	7.04	6.68	6.06	5.14	4.85	5.69 /	10.17
GHLC-S4	12.55	12.55	9.91	8.20	7.09	6.33	6.06	5.12	4.85	5.70 /	10.24
GHLC-S5	12.56	12.55	9.91	8.20	7.11	6.37	6.06	5.09	4.83	5.67 /	10.24
GHLC-S6	12.57	12.57	10.29	8.48	7.41	6.46	6.18	5.25	4.83	5.64 /	10.21
GHLC-S7	12.56	12.56	10.25	8.50	7.43	6.50	6.16	5.25	4.84	5.66 /	10.21
GHLC-S8	12.50	12.50	10.21	8.47	7.49	6.51	6.21	5.26	4.83	5.65 /	10.25

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、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-S9	12.56	12.56	10.25	8.50	7.53	6.53	6.21	5.27	4.83	5.65 / 10.23
GHLC-S10	12.50	12.50	10.26	8.51	7.53	6.56	6.23	5.28	4.84	5.62 / 10.21

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。