

P S J 予測統計値
(中央値)

2010年 6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、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、銀行・スタンレー-MUFG、クレディスイス、ドイツ、JP銀行、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	13.45	13.02	10.56	9.51	8.75	7.86	7.43	6.98	6.68	6.40 / 10.50	
JHF-2	12.93	12.93	10.45	9.55	8.70	7.86	7.40	6.96	6.66	6.29 / 10.44	
JHF-3	13.27	13.09	10.57	9.51	8.82	7.86	7.43	6.99	6.69	6.46 / 10.58	
JHF-4	13.67	13.24	10.67	9.64	8.90	7.93	7.46	6.99	6.69	6.68 / 10.53	
JHF-5	13.86	13.64	10.93	9.76	9.01	7.95	7.53	7.04	6.70	6.92 / 10.93	
JHF-6	14.00	13.23	10.66	9.61	8.87	7.99	7.49	7.01	6.68	6.64 / 10.74	
JHF-7	13.78	12.45	10.03	9.19	8.48	7.88	7.43	6.91	6.65	6.05 / 10.26	
JHF-8	13.42	13.19	10.45	9.50	8.78	8.04	7.51	7.01	6.66	6.44 / 10.68	
JHF-9	13.61	12.62	10.10	9.22	8.47	7.80	7.48	6.91	6.59	6.01 / 10.37	
JHF-10	13.27	11.92	9.69	8.97	8.23	7.73	7.43	6.87	6.61	5.78 / 10.07	
JHF-11	13.70	12.49	10.06	9.24	8.46	7.84	7.43	6.92	6.65	6.08 / 10.50	
JHF-12	13.25	12.33	9.93	9.13	8.38	7.82	7.44	6.91	6.64	6.09 / 10.39	
JHF-13	13.52	12.15	9.86	9.09	8.38	7.74	7.44	6.88	6.64	6.05 / 10.45	
JHF-14	12.75	11.86	9.67	8.93	8.29	7.68	7.33	6.86	6.64	5.87 / 10.14	
JHF-15	13.90	13.17	10.44	9.50	8.70	7.94	7.47	7.02	6.69	6.72 / 11.10	
JHF-16	14.23	13.66	11.29	9.74	8.88	8.08	7.54	7.08	6.70	7.62 / 11.43	
JHF-17	14.10	13.43	10.71	9.66	8.72	7.95	7.59	7.05	6.69	6.86 / 11.23	
JHF-18	13.96	13.03	10.42	9.42	8.69	7.91	7.52	7.01	6.70	6.69 / 10.95	
JHF-19	13.60	12.37	9.88	9.08	8.30	7.84	7.49	6.88	6.65	6.31 / 10.26	
JHF-20	13.61	12.55	9.97	9.20	8.35	7.89	7.53	6.91	6.68	6.34 / 10.42	
JHF-21	13.79	13.03	10.22	9.36	8.55	7.94	7.56	6.94	6.71	6.57 / 10.75	
JHF-22	13.70	12.94	10.21	9.33	8.54	7.79	7.51	6.95	6.71	6.70 / 10.87	
JHF-23	14.52	13.78	10.70	9.58	8.73	7.91	7.49	7.02	6.76	7.18 / 11.36	
JHF-24	14.08	13.51	10.46	9.41	8.62	7.85	7.59	7.00	6.74	6.84 / 11.23	
JHF-25	14.01	13.56	10.43	9.35	8.60	7.85	7.56	6.99	6.75	6.74 / 11.13	
JHF-26	14.38	13.96	10.55	9.43	8.73	8.12	7.63	7.04	6.76	7.16 / 11.17	
JHF-27	14.02	13.83	10.43	9.31	8.63	8.09	7.65	7.00	6.78	6.85 / 11.00	
JHF-28	13.33	13.13	9.91	9.00	8.34	7.86	7.46	6.97	6.77	6.38 / 10.47	
JHF-29	13.21	12.83	9.82	8.96	8.28	7.83	7.43	7.00	6.80	6.35 / 10.28	
JHF-30	12.80	12.37	9.73	8.90	8.19	7.75	7.38	7.00	6.81	6.29 / 10.05	
JHF-31	12.76	12.00	9.60	8.81	8.13	7.77	7.34	7.00	6.82	6.16 / 9.87	
JHF-32	13.04	12.44	9.86	8.97	8.25	7.82	7.44	7.07	6.88	6.21 / 10.21	
JHF-33	12.71	11.88	9.68	8.78	8.11	7.81	7.37	7.06	6.88	6.11 / 9.93	
JHF-34	12.79	11.97	9.74	8.85	8.14	7.85	7.41	7.11	6.93	6.08 / 10.12	
JHF-35	10.55	10.25	8.92	8.15	7.89	7.85	7.30	7.06	6.91	5.69 / 9.62	
JHF-36	10.43	10.12	8.81	8.09	7.88	7.86	7.30	7.08	6.93	5.65 / 9.55	
JHF-37	10.34	10.04	8.71	8.08	7.90	7.72	7.30	7.07	6.92	5.67 / 9.61	
GHLC-1	12.50	12.50	11.27	9.59	7.49	6.78	6.48	5.36	5.00	5.35 / 10.03	
GHLC-2	12.62	12.62	11.33	9.47	7.55	6.79	6.56	5.30	4.99	5.60 / 9.88	
GHLC-3	12.75	12.75	11.26	9.26	7.57	6.82	6.56	5.28	4.99	5.62 / 9.69	
GHLC-4	12.57	12.57	10.88	9.20	7.68	6.68	6.44	5.40	4.95	5.98 / 9.88	
GHLC-5	12.60	12.60	10.87	9.22	7.68	6.71	6.49	5.50	5.03	6.08 / 9.87	
GHLC-6	12.91	12.91	10.70	9.35	7.95	6.79	6.44	5.49	5.08	6.30 / 9.67	
GHLC-7	12.99	12.99	10.79	9.31	8.12	6.84	6.42	5.52	5.07	6.24 / 9.32	
GHLC-8	12.98	12.98	10.66	9.25	8.11	6.84	6.39	5.53	5.12	6.21 / 9.38	
GHLC-9	13.00	12.79	10.49	9.10	7.89	6.90	6.32	5.49	5.16	6.10 / 9.20	
GHLC-10	12.80	12.50	10.18	8.99	7.81	6.89	6.26	5.45	5.22	5.97 / 9.11	
GHLC-11	12.47	12.47	9.70	8.69	7.66	6.77	6.17	5.44	5.24	5.57 / 9.29	
GHLC-12	12.20	12.19	9.45	8.46	7.62	6.67	6.10	5.52	5.20	5.61 / 8.81	
GHLC-13	12.33	11.85	9.57	8.55	7.68	6.71	6.15	5.51	5.27	5.67 / 8.83	
GHLC-14	12.42	11.94	9.63	8.67	7.73	6.77	6.17	5.53	5.23	5.50 / 8.76	

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	12.19	9.53	8.56	7.68	6.74	6.16	5.53	5.22	5.54 / 8.80		
GHLC-16	12.25	11.95	9.47	8.51	7.68	6.68	6.12	5.56	5.23	5.57 / 8.71		
GHLC-17	12.27	12.24	9.48	8.56	7.67	6.70	6.15	5.60	5.23	5.66 / 8.76		
GHLC-18	12.17	12.14	9.48	8.33	7.63	6.68	6.17	5.60	5.23	5.66 / 8.70		
GHLC-19	12.07	12.05	9.37	8.21	7.59	6.64	6.18	5.62	5.20	5.54 / 8.64		
GHLC-20	12.04	12.04	9.34	8.28	7.53	6.65	6.30	5.74	5.30	5.40 / 8.74		
GHLC-21	11.97	11.86	9.36	8.05	7.55	6.84	6.30	5.81	5.36	5.59 / 8.88		
GHLC-22	12.20	11.59	9.59	8.12	7.70	6.95	6.18	5.78	5.43	5.66 / 9.10		
GHLC-23	12.25	12.25	9.55	8.09	7.72	7.00	6.33	5.81	5.43	5.68 / 9.15		
GHLC-24	12.16	11.52	9.53	8.09	7.70	7.07	6.26	5.85	5.46	5.57 / 9.21		
GHLC-25	11.95	11.57	9.41	8.01	7.61	7.14	6.37	5.86	5.50	5.47 / 9.17		
GHLC-26	11.68	11.67	9.13	7.98	7.42	6.77	6.23	5.74	5.40	5.42 / 8.81		
GHLC-27	10.61	10.61	8.62	7.87	7.33	6.78	6.33	5.81	5.46	5.10 / 8.95		
GHLC-28	11.53	11.53	9.10	7.86	7.42	6.81	6.31	5.81	5.48	5.41 / 8.96		
GHLC-29	10.51	10.51	8.38	7.87	7.32	6.71	6.34	5.82	5.48	5.13 / 8.93		
GHLC-30	10.39	10.26	8.24	7.91	7.32	6.66	6.31	5.75	5.52	5.21 / 8.94		
GHLC-31	10.37	10.10	8.08	7.75	7.12	6.56	6.19	5.65	5.48	4.94 / 8.74		
GHLC-32	10.28	9.72	8.01	7.59	7.05	6.55	6.14	5.66	5.49	4.88 / 8.63		
GHLC-33	10.48	10.35	8.12	7.80	7.17	6.58	6.23	5.64	5.47	5.05 / 8.78		
GHLC-34	10.34	10.12	7.98	7.59	7.00	6.52	6.13	5.61	5.49	4.96 / 8.55		
GHLC-35	10.34	10.33	8.04	7.63	7.06	6.53	6.16	5.59	5.46	5.06 / 8.57		
GHLC-36	11.18	10.67	8.30	7.88	7.42	6.62	6.28	5.69	5.52	5.21 / 8.77		
GHLC-37	11.05	10.53	8.26	7.79	7.32	6.62	6.28	5.63	5.48	5.07 / 8.69		
GHLC-38	11.48	10.82	8.48	7.98	7.55	6.76	6.30	5.70	5.48	5.28 / 8.83		
GHLC-39	11.45	10.61	8.37	7.85	7.46	6.66	6.28	5.65	5.50	5.22 / 8.70		
GHLC-40	12.03	11.30	8.62	8.10	7.55	6.87	6.36	5.75	5.50	5.56 / 8.99		
GHLC-41	11.46	10.74	8.37	7.88	7.47	6.69	6.27	5.68	5.54	5.32 / 8.74		
GHLC-42	11.63	11.08	8.66	8.17	7.64	6.85	6.38	5.74	5.58	5.64 / 8.96		
GHLC-43	12.13	11.51	9.12	8.35	7.62	6.99	6.47	5.73	5.59	5.92 / 9.15		
GHLC-44	12.57	12.36	9.77	8.62	7.88	7.14	6.51	5.85	5.63	6.26 / 9.46		
GHLC-45	12.09	12.04	9.46	8.49	7.71	7.09	6.46	5.78	5.58	6.10 / 9.22		
GHLC-46	12.28	12.00	9.57	8.54	7.76	7.16	6.50	5.81	5.61	6.14 / 9.25		
GHLC-47	12.73	12.09	9.55	8.52	7.82	7.15	6.52	5.79	5.55	6.13 / 9.16		
GHLC-48	11.92	11.27	8.86	8.15	7.76	6.85	6.36	5.75	5.55	5.60 / 8.77		
GHLC-49	11.89	11.34	8.94	8.13	7.77	6.83	6.35	5.71	5.54	5.65 / 8.71		
GHLC-50	12.34	12.10	9.47	8.51	7.78	7.10	6.50	5.76	5.59	6.08 / 9.09		
GHLC-51	12.75	11.60	9.11	8.27	7.82	6.92	6.40	5.69	5.54	5.87 / 8.79		
GHLC-52	11.76	11.28	8.68	8.14	7.79	6.78	6.21	5.71	5.55	5.61 / 8.58		
GHLC-53	11.97	11.45	8.87	8.27	7.82	6.84	6.31	5.77	5.58	5.85 / 8.68		
JHF-S1	12.25	12.25	10.39	9.10	7.66	6.65	6.35	5.51	5.25	6.11 / 9.35		
JHF-S2	12.25	12.25	10.16	8.90	7.66	6.65	6.35	5.51	5.21	6.10 / 9.17		
JHF-S3	12.27	12.27	10.08	8.86	7.71	6.68	6.32	5.55	5.23	6.15 / 9.06		
JHF-S4	12.18	12.18	9.58	8.61	7.62	6.74	6.30	5.60	5.18	5.81 / 8.92		
JHF-S5	12.02	11.97	9.34	8.40	7.53	6.71	6.24	5.68	5.15	5.63 / 8.74		
JHF-S6	12.08	11.98	9.37	8.48	7.56	6.74	6.25	5.72	5.14	5.66 / 8.70		
JHF-S7	12.10	12.03	9.36	8.46	7.58	6.72	6.26	5.71	5.13	5.66 / 8.64		
JHF-S8	11.67	11.13	8.88	8.21	7.35	6.49	6.08	5.61	5.22	5.34 / 8.21		
JHF-S9	11.70	11.10	8.85	8.22	7.33	6.49	6.10	5.62	5.23	5.35 / 8.21		
JHF-S10	11.10	10.72	8.62	7.86	7.23	6.71	6.19	5.67	5.37	5.24 / 8.36		
JHF-S11	11.39	11.26	9.01	8.15	7.50	6.96	6.28	5.82	5.50	5.58 / 8.85		
JHF-S12	11.99	11.05	9.11	8.20	7.56	6.99	6.36	5.86	5.58	5.72 / 8.94		
JHF-S13	7.70	7.70	7.25	6.93	6.11	5.09	4.80	4.37	3.74	2.83 / 8.32		
JHF-S14	7.72	7.72	7.24	6.90	6.22	5.12	4.77	4.33	3.74	2.82 / 8.21		
JHF-S15	7.77	7.77	7.27	6.91	6.26	5.17	4.78	4.32	3.74	2.81 / 8.11		
JHF-S16	8.14	8.14	7.76	7.06	6.40	5.56	4.95	4.39	3.89	3.16 / 8.18		

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-S17	8.12	8.12	7.75	7.04	6.34	5.55	4.91	4.33	3.91	3.11 / 8.00
JHF-S18	8.15	8.15	7.77	7.08	6.40	5.56	4.95	4.20	3.92	3.11 / 7.91
GHLC-S1	11.81	11.81	10.36	8.58	7.38	6.66	6.35	5.43	5.02	6.63 / 10.04
GHLC-S2	11.69	11.69	10.28	8.52	7.40	6.72	6.34	5.42	4.99	6.55 / 10.07
GHLC-S3	11.87	11.87	10.37	8.68	7.46	6.60	6.38	5.39	5.01	6.61 / 10.00
GHLC-S4	11.83	11.83	10.33	8.77	7.43	6.64	6.40	5.47	5.08	6.45 / 10.03
GHLC-S5	11.85	11.85	10.22	8.78	7.47	6.59	6.42	5.47	5.06	6.42 / 9.88
GHLC-S6	12.14	12.14	10.37	9.01	7.87	6.62	6.44	5.56	5.23	6.32 / 9.64
GHLC-S7	12.08	12.08	10.25	9.00	7.74	6.64	6.43	5.53	5.22	6.36 / 9.63
GHLC-S8	12.08	12.08	10.34	8.99	7.87	6.64	6.41	5.52	5.25	6.31 / 9.58
GHLC-S9	12.12	12.12	10.37	8.96	7.84	6.64	6.44	5.47	5.23	6.33 / 9.59
GHLC-S10	12.09	12.09	10.19	8.99	7.67	6.65	6.41	5.49	5.24	6.30 / 9.53

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。