

P S J 予測統計値
(平均値)

2009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、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エムビー、UBS、メリル・リンチ日本、大和SMBC、新生、日興フィグループ												
回号	Yield Curve Scenarios (%)										最低 / 最高(%)	
	-300bp	-200bp	-100bp	-50bp	0bp	50bp	100bp	200bp	300bp			
JHF-1	13.25	12.59	10.82	9.53	8.54	7.82	7.30	6.79	6.51	7.04 / 11.58		
JHF-2	13.23	12.55	10.79	9.50	8.52	7.80	7.29	6.78	6.51	6.96 / 11.52		
JHF-3	13.44	12.77	10.97	9.54	8.60	7.86	7.33	6.82	6.54	7.08 / 11.72		
JHF-4	13.68	12.95	11.08	9.64	8.65	7.90	7.36	6.83	6.54	7.17 / 11.69		
JHF-5	14.03	13.35	11.38	9.87	8.78	8.03	7.43	6.85	6.56	7.22 / 12.09		
JHF-6	13.81	13.13	11.16	9.72	8.69	7.97	7.40	6.84	6.56	7.14 / 11.84		
JHF-7	12.99	12.34	10.56	9.34	8.46	7.78	7.29	6.80	6.54	6.89 / 11.35		
JHF-8	13.73	13.06	11.06	9.65	8.68	7.91	7.39	6.85	6.57	7.06 / 11.82		
JHF-9	13.21	12.50	10.68	9.42	8.53	7.82	7.33	6.83	6.56	6.93 / 11.49		
JHF-10	12.67	12.06	10.31	9.20	8.37	7.71	7.27	6.81	6.55	6.75 / 11.19		
JHF-11	13.23	12.60	10.80	9.50	8.57	7.85	7.37	6.88	6.61	6.96 / 11.73		
JHF-12	13.16	12.55	10.67	9.39	8.53	7.83	7.36	6.88	6.61	6.99 / 11.62		
JHF-13	13.10	12.40	10.60	9.40	8.53	7.85	7.38	6.91	6.64	7.02 / 11.74		
JHF-14	12.80	12.14	10.38	9.20	8.39	7.76	7.33	6.88	6.62	6.89 / 11.40		
JHF-15	14.32	13.63	11.52	9.95	8.89	8.11	7.55	7.01	6.71	7.29 / 12.53		
JHF-16	15.17	14.41	12.06	10.32	9.11	8.28	7.67	7.06	6.75	7.39 / 12.98		
JHF-17	14.60	13.87	11.65	10.13	9.02	8.23	7.65	7.08	6.78	7.33 / 12.78		
JHF-18	14.34	13.59	11.42	9.97	8.92	8.14	7.60	7.06	6.76	7.29 / 12.43		
JHF-19	13.37	12.72	10.75	9.49	8.64	7.95	7.49	7.00	6.73	7.20 / 11.61		
JHF-20	13.63	12.89	10.90	9.62	8.73	8.02	7.54	7.05	6.76	7.22 / 11.81		
JHF-21	14.17	13.47	11.28	9.87	8.89	8.14	7.62	7.10	6.81	7.28 / 12.30		
JHF-22	14.29	13.54	11.36	9.92	8.90	8.17	7.65	7.13	6.85	7.30 / 12.44		
JHF-23	15.15	14.30	11.92	10.28	9.13	8.34	7.77	7.20	6.89	7.39 / 13.01		
JHF-24	14.78	13.95	11.63	10.19	9.06	8.30	7.75	7.19	6.90	7.36 / 12.86		
JHF-25	14.79	13.94	11.65	10.16	9.04	8.29	7.74	7.19	6.88	7.37 / 12.64		
GHLC-1	12.38	11.79	10.37	8.71	7.32	6.32	5.63	4.86	4.53	5.19 / 10.11		
GHLC-2	12.42	11.83	10.31	8.61	7.30	6.30	5.63	4.89	4.56	5.21 / 10.04		
GHLC-3	12.48	11.90	10.34	8.64	7.26	6.31	5.65	4.93	4.62	5.17 / 10.00		
GHLC-4	12.32	11.75	10.15	8.50	7.18	6.29	5.68	4.99	4.69	5.06 / 10.00		
GHLC-5	12.24	11.72	10.13	8.42	7.21	6.33	5.74	5.06	4.78	5.07 / 9.98		
GHLC-6	12.60	12.01	10.37	8.64	7.39	6.47	5.87	5.17	4.90	5.14 / 9.93		
GHLC-7	12.55	11.98	10.31	8.56	7.37	6.47	5.85	5.18	4.89	5.14 / 9.91		
GHLC-8	12.58	12.01	10.36	8.64	7.39	6.51	5.90	5.22	4.94	5.16 / 9.90		
GHLC-9	12.53	11.90	10.15	8.48	7.31	6.47	5.88	5.23	4.96	5.14 / 9.73		
GHLC-10	12.40	11.83	10.05	8.42	7.25	6.45	5.88	5.25	4.99	5.11 / 9.59		
GHLC-11	12.20	11.65	9.85	8.26	7.17	6.42	5.89	5.29	5.04	5.09 / 9.32		
GHLC-12	12.00	11.43	9.61	8.13	7.09	6.39	5.89	5.34	5.09	5.06 / 9.13		
GHLC-13	12.11	11.56	9.73	8.23	7.16	6.42	5.91	5.37	5.11	5.12 / 9.22		
GHLC-14	12.17	11.56	9.79	8.27	7.18	6.44	5.91	5.34	5.08	5.11 / 9.31		
GHLC-15	12.13	11.54	9.75	8.21	7.18	6.45	5.93	5.36	5.10	5.09 / 9.23		
GHLC-16	12.11	11.58	9.69	8.24	7.18	6.44	5.93	5.37	5.11	5.09 / 9.21		
GHLC-17	12.17	11.59	9.77	8.23	7.21	6.48	5.97	5.41	5.15	5.15 / 9.17		
GHLC-18	12.04	11.47	9.68	8.21	7.18	6.46	5.95	5.41	5.16	5.14 / 9.11		
GHLC-19	12.06	11.48	9.64	8.22	7.18	6.48	5.96	5.42	5.16	5.13 / 9.08		
GHLC-20	12.08	11.47	9.69	8.27	7.29	6.54	6.03	5.49	5.23	5.20 / 9.03		
GHLC-21	12.08	11.54	9.69	8.29	7.32	6.58	6.08	5.54	5.28	5.25 / 8.99		
GHLC-22	12.21	11.64	9.78	8.38	7.34	6.60	6.08	5.54	5.27	5.33 / 9.15		
GHLC-23	12.31	11.68	9.86	8.46	7.40	6.64	6.12	5.57	5.31	5.34 / 9.15		
GHLC-24	12.25	11.66	9.82	8.41	7.42	6.66	6.13	5.60	5.34	5.41 / 9.12		
GHLC-25	11.99	11.41	9.65	8.36	7.36	6.64	6.12	5.60	5.34	5.43 / 8.96		
GHLC-26	11.77	11.15	9.44	8.11	7.21	6.50	6.03	5.54	5.28	5.23 / 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、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、日興フィグループ

回号	Yield Curve Scenarios (%)									最低 / 最高(%)	
	-300bp	-200bp	-100bp	-50bp	0bp	50bp	100bp	200bp	300bp		
GHLC-27	11.06	10.44	9.00	7.87	7.06	6.40	5.99	5.56	5.32	5.34 /	8.34
GHLC-28	11.66	11.07	9.34	8.10	7.20	6.50	6.04	5.56	5.31	5.32 /	8.61
GHLC-29	10.97	10.37	8.91	7.88	7.02	6.39	5.99	5.57	5.34	5.37 /	8.41
GHLC-30	10.85	10.27	8.90	7.81	7.01	6.39	6.00	5.58	5.34	5.40 /	8.52
GHLC-31	10.66	10.08	8.71	7.69	6.90	6.31	5.94	5.54	5.31	5.31 /	8.20
GHLC-32	10.44	9.84	8.53	7.60	6.84	6.26	5.93	5.54	5.32	5.30 /	7.99
GHLC-33	10.80	10.16	8.84	7.79	6.95	6.35	5.98	5.57	5.34	5.35 /	8.26
GHLC-34	10.44	9.92	8.57	7.60	6.84	6.28	5.94	5.55	5.33	5.29 /	8.03
GHLC-35	10.62	9.98	8.64	7.64	6.87	6.31	5.95	5.56	5.33	5.31 /	8.07
GHLC-36	11.04	10.43	9.01	7.91	7.05	6.43	6.03	5.60	5.36	5.37 /	8.60
GHLC-37	10.94	10.35	8.89	7.84	6.98	6.38	5.99	5.57	5.33	5.36 /	8.42
GHLC-38	11.28	10.68	9.18	8.00	7.14	6.47	6.04	5.60	5.35	5.42 /	8.71
GHLC-39	11.13	10.54	9.03	7.93	7.07	6.44	6.03	5.60	5.35	5.39 /	8.63
GHLC-40	11.68	11.01	9.42	8.18	7.27	6.57	6.10	5.63	5.38	5.47 /	9.00
GHLC-41	11.25	10.61	9.14	8.00	7.14	6.48	6.06	5.61	5.37	5.41 /	8.73
GHLC-42	11.73	11.08	9.42	8.21	7.29	6.58	6.12	5.66	5.40	5.50 /	9.15
GHLC-43	12.13	11.47	9.68	8.38	7.41	6.67	6.16	5.67	5.41	5.58 /	9.39
GHLC-44	12.89	12.16	10.25	8.82	7.68	6.86	6.30	5.73	5.45	5.72 /	10.01
GHLC-45	12.59	11.91	10.07	8.63	7.58	6.79	6.25	5.71	5.43	5.64 /	9.76
GHLC-46	12.76	12.01	10.14	8.73	7.62	6.84	6.27	5.72	5.44	5.67 /	10.00
GHLC-47	12.79	12.10	10.18	8.68	7.64	6.88	6.29	5.73	5.45	5.69 /	9.97
GHLC-48	12.03	11.42	9.64	8.36	7.39	6.71	6.19	5.69	5.42	5.53 /	9.46
GHLC-49	12.05	11.37	9.57	8.32	7.37	6.69	6.17	5.67	5.41	5.52 /	9.45
GHLC-50	12.88	12.15	10.13	8.76	7.64	6.89	6.30	5.74	5.46	5.68 /	10.05
GHLC-51	12.38	11.70	9.78	8.46	7.47	6.75	6.21	5.69	5.43	5.58 /	9.61
GHLC-52	11.97	11.28	9.52	8.25	7.35	6.65	6.16	5.68	5.41	5.53 /	9.34
GHLC-53	12.27	11.63	9.80	8.40	7.46	6.75	6.22	5.72	5.44	5.59 /	9.68
JHF-S1	12.32	11.73	10.15	8.57	7.37	6.48	5.87	5.16	4.87	5.04 /	9.71
JHF-S2	12.28	11.74	10.10	8.59	7.36	6.46	5.86	5.15	4.86	5.03 /	9.70
JHF-S3	12.31	11.75	10.15	8.59	7.38	6.50	5.88	5.18	4.88	5.05 /	9.64
JHF-S4	12.19	11.60	9.92	8.40	7.28	6.46	5.89	5.26	4.98	5.02 /	9.44
JHF-S5	11.98	11.42	9.71	8.22	7.15	6.40	5.86	5.27	5.01	4.99 /	9.26
JHF-S6	12.02	11.46	9.76	8.28	7.19	6.42	5.88	5.29	5.02	4.99 /	9.30
JHF-S7	12.02	11.51	9.73	8.28	7.18	6.42	5.88	5.28	5.03	4.99 /	9.26
JHF-S8	11.54	10.96	9.27	7.90	6.99	6.33	5.87	5.38	5.14	4.97 /	8.87
JHF-S9	11.57	10.97	9.29	7.92	6.99	6.34	5.87	5.37	5.14	4.97 /	8.89
JHF-S10	11.31	10.75	9.03	7.86	7.03	6.37	5.96	5.50	5.26	5.11 /	8.50
JHF-S11	11.76	11.25	9.45	8.14	7.26	6.55	6.09	5.60	5.35	5.30 /	8.83
JHF-S12	12.06	11.44	9.65	8.31	7.39	6.66	6.19	5.69	5.44	5.39 /	9.23
JHF-S13	7.75	7.56	6.84	5.99	5.35	4.87	4.51	4.01	3.79	2.97 /	7.52
GHLC-S1	12.21	11.59	10.13	8.61	7.35	6.40	5.71	4.94	4.62	5.13 /	9.74
GHLC-S2	12.10	11.54	10.06	8.54	7.30	6.37	5.70	4.94	4.61	5.09 /	9.70
GHLC-S3	12.09	11.58	10.12	8.60	7.33	6.36	5.72	4.96	4.65	5.16 /	9.73
GHLC-S4	12.19	11.60	10.12	8.54	7.32	6.40	5.76	5.02	4.71	5.08 /	9.80
GHLC-S5	12.17	11.60	10.11	8.59	7.30	6.38	5.74	5.01	4.70	5.07 /	9.78
GHLC-S6	12.30	11.75	10.22	8.60	7.37	6.45	5.81	5.09	4.78	5.04 /	9.78
GHLC-S7	12.27	11.69	10.16	8.62	7.36	6.45	5.80	5.08	4.77	5.05 /	9.78
GHLC-S8	12.28	11.68	10.14	8.59	7.37	6.45	5.81	5.08	4.78	5.05 /	9.76
GHLC-S9	12.26	11.71	10.12	8.57	7.35	6.44	5.80	5.08	4.78	5.05 /	9.74
GHLC-S10	12.18	11.65	10.12	8.58	7.35	6.43	5.80	5.07	4.77	5.04 /	9.76

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。