

PSJ 予測統計値
(平均値)

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、三井住友銀行、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-1	13.49	12.59	10.74	9.45	8.53	7.83	7.27	6.73	6.46	6.40 / 10.50	
JHF-2	13.39	12.53	10.67	9.43	8.49	7.79	7.25	6.71	6.45	6.29 / 10.44	
JHF-3	13.55	12.70	10.79	9.48	8.55	7.84	7.29	6.74	6.47	6.46 / 10.58	
JHF-4	13.76	12.85	10.92	9.60	8.60	7.86	7.30	6.74	6.47	6.68 / 10.53	
JHF-5	14.15	13.22	11.24	9.79	8.76	7.99	7.40	6.78	6.50	6.92 / 10.93	
JHF-6	13.94	13.00	10.99	9.67	8.64	7.91	7.34	6.76	6.48	6.64 / 10.74	
JHF-7	13.12	12.27	10.43	9.23	8.35	7.72	7.20	6.71	6.46	6.05 / 10.26	
JHF-8	13.81	12.97	10.92	9.54	8.59	7.87	7.32	6.77	6.49	6.44 / 10.68	
JHF-9	13.24	12.44	10.51	9.28	8.39	7.74	7.23	6.73	6.48	6.01 / 10.37	
JHF-10	12.68	11.94	10.15	8.98	8.21	7.60	7.14	6.69	6.45	5.78 / 10.07	
JHF-11	13.23	12.44	10.49	9.29	8.40	7.73	7.24	6.75	6.49	6.08 / 10.50	
JHF-12	13.07	12.31	10.45	9.20	8.35	7.69	7.21	6.74	6.49	6.09 / 10.39	
JHF-13	12.95	12.20	10.35	9.13	8.32	7.68	7.22	6.75	6.51	6.05 / 10.45	
JHF-14	12.64	11.87	10.08	8.97	8.19	7.58	7.15	6.72	6.49	5.87 / 10.14	
JHF-15	14.01	13.21	11.12	9.71	8.67	7.91	7.37	6.82	6.55	6.72 / 11.10	
JHF-16	14.65	13.80	11.64	10.05	8.90	8.08	7.48	6.86	6.58	7.62 / 11.43	
JHF-17	14.20	13.40	11.27	9.76	8.74	8.02	7.45	6.88	6.60	6.86 / 11.23	
JHF-18	13.94	13.08	11.02	9.56	8.61	7.91	7.38	6.84	6.58	6.69 / 10.95	
JHF-19	13.12	12.29	10.35	9.13	8.34	7.72	7.25	6.79	6.56	6.31 / 10.26	
JHF-20	13.25	12.47	10.46	9.21	8.40	7.77	7.29	6.82	6.58	6.34 / 10.42	
JHF-21	13.70	12.90	10.75	9.41	8.52	7.85	7.35	6.86	6.61	6.57 / 10.75	
JHF-22	13.75	12.94	10.80	9.43	8.55	7.86	7.38	6.88	6.63	6.70 / 10.87	
JHF-23	14.50	13.68	11.32	9.80	8.78	8.02	7.50	6.94	6.67	7.18 / 11.36	
JHF-24	14.18	13.32	11.08	9.65	8.68	7.96	7.46	6.93	6.67	6.84 / 11.23	
JHF-25	14.19	13.31	11.04	9.58	8.65	7.93	7.44	6.92	6.66	6.74 / 11.13	
JHF-26	14.66	13.78	11.38	9.80	8.77	8.03	7.50	6.95	6.69	7.16 / 11.17	
JHF-27	14.26	13.38	11.08	9.61	8.67	7.98	7.48	6.96	6.70	6.85 / 11.00	
JHF-28	13.37	12.52	10.41	9.16	8.42	7.82	7.37	6.92	6.68	6.38 / 10.47	
JHF-29	13.14	12.31	10.27	9.06	8.38	7.78	7.36	6.93	6.70	6.35 / 10.28	
JHF-30	12.84	12.01	10.01	9.00	8.30	7.73	7.35	6.93	6.71	6.29 / 10.05	
JHF-31	12.59	11.84	9.89	8.87	8.24	7.70	7.33	6.93	6.71	6.16 / 9.87	
JHF-32	12.94	12.15	10.11	9.04	8.36	7.79	7.40	6.99	6.76	6.21 / 10.21	
JHF-33	12.58	11.77	9.89	8.88	8.26	7.73	7.37	6.98	6.75	6.11 / 9.93	
JHF-34	12.61	11.85	9.95	8.93	8.31	7.76	7.42	7.02	6.80	6.08 / 10.12	
JHF-35	11.39	10.69	9.11	8.39	7.91	7.51	7.25	6.93	6.73	5.69 / 9.62	
JHF-36	11.23	10.53	8.99	8.27	7.84	7.47	7.23	6.91	6.73	5.65 / 9.55	
JHF-37	11.21	10.49	8.94	8.29	7.82	7.45	7.20	6.89	6.70	5.67 / 9.61	
GHLC-1	12.32	11.67	10.72	9.28	7.97	6.86	6.05	5.15	4.77	5.35 / 10.03	
GHLC-2	12.35	11.70	10.67	9.26	7.90	6.82	6.06	5.19	4.82	5.60 / 9.88	
GHLC-3	12.36	11.71	10.68	9.21	7.86	6.78	6.06	5.23	4.87	5.62 / 9.69	
GHLC-4	12.45	11.79	10.67	9.18	7.85	6.78	6.09	5.29	4.96	5.98 / 9.88	
GHLC-5	12.39	11.83	10.75	9.20	7.85	6.82	6.14	5.37	5.04	6.08 / 9.87	
GHLC-6	12.51	11.91	10.76	9.22	7.86	6.84	6.18	5.42	5.10	6.30 / 9.67	
GHLC-7	12.50	11.92	10.73	9.14	7.78	6.80	6.15	5.40	5.09	6.24 / 9.32	
GHLC-8	12.50	11.91	10.67	9.14	7.79	6.82	6.18	5.44	5.14	6.21 / 9.38	
GHLC-9	12.35	11.74	10.46	8.92	7.64	6.71	6.11	5.42	5.14	6.10 / 9.20	
GHLC-10	12.24	11.66	10.34	8.78	7.54	6.67	6.09	5.42	5.15	5.97 / 9.11	
GHLC-11	12.10	11.50	10.07	8.60	7.40	6.61	6.07	5.44	5.19	5.57 / 9.29	
GHLC-12	11.92	11.36	9.84	8.37	7.28	6.56	6.05	5.47	5.24	5.61 / 8.81	
GHLC-13	12.03	11.44	9.93	8.44	7.32	6.57	6.06	5.48	5.24	5.67 / 8.83	
GHLC-14	12.06	11.47	10.00	8.50	7.37	6.62	6.08	5.48	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	12.06	11.46	9.94	8.46	7.34	6.61	6.07	5.48	5.24	5.54 / 8.80	
GHLC-16	12.02	11.44	9.93	8.47	7.33	6.59	6.08	5.49	5.25	5.57 / 8.71	
GHLC-17	12.07	11.50	9.95	8.49	7.37	6.63	6.11	5.53	5.29	5.66 / 8.76	
GHLC-18	12.00	11.46	9.88	8.42	7.38	6.64	6.12	5.54	5.31	5.66 / 8.70	
GHLC-19	11.96	11.39	9.82	8.39	7.33	6.61	6.09	5.52	5.29	5.54 / 8.64	
GHLC-20	12.06	11.48	9.85	8.42	7.42	6.69	6.17	5.59	5.35	5.40 / 8.74	
GHLC-21	12.10	11.47	9.82	8.41	7.46	6.71	6.20	5.64	5.40	5.59 / 8.88	
GHLC-22	12.20	11.58	9.94	8.52	7.50	6.74	6.21	5.64	5.40	5.66 / 9.10	
GHLC-23	12.30	11.68	9.97	8.56	7.54	6.78	6.25	5.67	5.42	5.68 / 9.15	
GHLC-24	12.24	11.61	9.90	8.52	7.55	6.82	6.27	5.71	5.45	5.57 / 9.21	
GHLC-25	12.10	11.45	9.72	8.43	7.47	6.80	6.25	5.70	5.45	5.47 / 9.17	
GHLC-26	11.83	11.30	9.61	8.25	7.35	6.67	6.18	5.65	5.42	5.42 / 8.81	
GHLC-27	11.16	10.58	8.99	7.96	7.20	6.57	6.12	5.66	5.43	5.10 / 8.95	
GHLC-28	11.80	11.21	9.44	8.19	7.34	6.67	6.17	5.67	5.44	5.41 / 8.96	
GHLC-29	11.09	10.45	8.92	7.95	7.17	6.54	6.10	5.65	5.43	5.13 / 8.93	
GHLC-30	10.95	10.29	8.92	7.91	7.14	6.51	6.09	5.65	5.43	5.21 / 8.94	
GHLC-31	10.80	10.11	8.73	7.75	7.04	6.45	6.04	5.62	5.41	4.94 / 8.74	
GHLC-32	10.54	9.95	8.56	7.69	6.99	6.42	6.04	5.63	5.43	4.88 / 8.63	
GHLC-33	10.92	10.25	8.79	7.85	7.10	6.50	6.07	5.64	5.43	5.05 / 8.78	
GHLC-34	10.63	10.03	8.62	7.71	7.00	6.41	6.04	5.63	5.42	4.96 / 8.55	
GHLC-35	10.75	10.13	8.71	7.75	7.03	6.44	6.05	5.64	5.43	5.06 / 8.57	
GHLC-36	11.27	10.56	9.01	7.96	7.21	6.56	6.13	5.67	5.45	5.21 / 8.77	
GHLC-37	11.10	10.47	8.90	7.91	7.14	6.51	6.08	5.64	5.42	5.07 / 8.69	
GHLC-38	11.50	10.81	9.17	8.12	7.28	6.61	6.15	5.67	5.44	5.28 / 8.83	
GHLC-39	11.33	10.67	9.04	7.99	7.20	6.56	6.11	5.65	5.43	5.22 / 8.70	
GHLC-40	11.91	11.16	9.45	8.25	7.40	6.70	6.20	5.70	5.46	5.56 / 8.99	
GHLC-41	11.43	10.76	9.10	8.08	7.25	6.61	6.14	5.67	5.44	5.32 / 8.74	
GHLC-42	11.85	11.14	9.42	8.28	7.40	6.71	6.20	5.70	5.45	5.64 / 8.96	
GHLC-43	12.32	11.53	9.75	8.48	7.56	6.81	6.27	5.73	5.47	5.92 / 9.15	
GHLC-44	13.03	12.18	10.26	8.90	7.85	7.01	6.41	5.79	5.51	6.26 / 9.46	
GHLC-45	12.76	11.97	10.01	8.71	7.71	6.92	6.34	5.76	5.48	6.10 / 9.22	
GHLC-46	12.91	12.08	10.14	8.80	7.76	6.97	6.36	5.77	5.49	6.14 / 9.25	
GHLC-47	13.02	12.10	10.15	8.79	7.77	7.00	6.40	5.78	5.50	6.13 / 9.16	
GHLC-48	12.25	11.45	9.62	8.38	7.46	6.79	6.26	5.72	5.47	5.60 / 8.77	
GHLC-49	12.30	11.48	9.58	8.34	7.45	6.78	6.25	5.71	5.46	5.65 / 8.71	
GHLC-50	13.01	12.15	10.17	8.74	7.75	6.98	6.39	5.77	5.49	6.08 / 9.09	
GHLC-51	12.60	11.72	9.75	8.46	7.54	6.84	6.28	5.73	5.48	5.87 / 8.79	
GHLC-52	12.16	11.38	9.53	8.28	7.40	6.74	6.21	5.70	5.46	5.61 / 8.58	
GHLC-53	12.44	11.65	9.70	8.43	7.51	6.82	6.27	5.74	5.48	5.85 / 8.68	
JHF-S1	12.26	11.66	10.41	9.12	7.87	6.88	6.22	5.43	5.10	6.11 / 9.35	
JHF-S2	12.18	11.59	10.42	9.03	7.84	6.85	6.20	5.41	5.09	6.10 / 9.17	
JHF-S3	12.17	11.61	10.39	9.06	7.84	6.86	6.19	5.42	5.09	6.15 / 9.06	
JHF-S4	12.06	11.47	10.16	8.80	7.63	6.74	6.15	5.45	5.17	5.81 / 8.92	
JHF-S5	11.88	11.37	9.96	8.57	7.45	6.64	6.09	5.44	5.18	5.63 / 8.74	
JHF-S6	11.96	11.43	10.02	8.63	7.49	6.68	6.12	5.46	5.20	5.66 / 8.70	
JHF-S7	11.95	11.42	10.00	8.57	7.47	6.66	6.10	5.44	5.19	5.66 / 8.64	
JHF-S8	11.58	11.05	9.56	8.16	7.18	6.52	6.05	5.51	5.29	5.34 / 8.21	
JHF-S9	11.57	11.07	9.58	8.18	7.18	6.51	6.04	5.51	5.28	5.35 / 8.21	
JHF-S10	11.45	10.92	9.30	8.03	7.19	6.57	6.12	5.62	5.40	5.24 / 8.36	
JHF-S11	11.90	11.33	9.57	8.27	7.39	6.70	6.21	5.68	5.44	5.58 / 8.85	
JHF-S12	12.16	11.47	9.74	8.42	7.48	6.77	6.26	5.72	5.48	5.72 / 8.94	
JHF-S13	7.66	7.44	6.79	6.08	5.43	4.90	4.52	4.02	3.77	2.83 / 8.32	
JHF-S14	7.63	7.43	6.75	6.06	5.40	4.87	4.48	3.99	3.74	2.82 / 8.21	
JHF-S15	7.65	7.44	6.75	6.09	5.41	4.89	4.50	4.00	3.76	2.81 / 8.11	
JHF-S16	8.13	7.92	7.22	6.42	5.73	5.14	4.72	4.15	3.91	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、メリリチ日本、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	8.10	7.91	7.18	6.43	5.71	5.13	4.71	4.13	3.89	3.11 / 8.00
JHF-S18	8.12	7.86	7.19	6.40	5.72	5.13	4.70	4.13	3.89	3.11 / 7.91
GHLC-S1	11.99	11.37	10.26	9.00	7.85	6.85	6.09	5.23	4.85	6.63 / 10.04
GHLC-S2	11.94	11.28	10.21	8.92	7.79	6.82	6.07	5.23	4.85	6.55 / 10.07
GHLC-S3	11.95	11.34	10.24	9.01	7.82	6.84	6.10	5.24	4.87	6.61 / 10.00
GHLC-S4	12.09	11.51	10.38	9.07	7.87	6.86	6.15	5.33	4.97	6.45 / 10.03
GHLC-S5	12.09	11.44	10.29	9.03	7.84	6.83	6.13	5.32	4.95	6.42 / 9.88
GHLC-S6	12.23	11.65	10.51	9.14	7.94	6.92	6.22	5.39	5.03	6.32 / 9.64
GHLC-S7	12.21	11.61	10.44	9.11	7.93	6.91	6.20	5.38	5.03	6.36 / 9.63
GHLC-S8	12.18	11.59	10.44	9.13	7.93	6.92	6.21	5.39	5.03	6.31 / 9.58
GHLC-S9	12.20	11.59	10.46	9.16	7.92	6.90	6.20	5.39	5.03	6.33 / 9.59
GHLC-S10	12.17	11.57	10.41	9.16	7.91	6.90	6.19	5.38	5.03	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。