

P S J 予測統計値
(中央値)

2010年 7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、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、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	13.44	13.05	10.99	9.98	9.11	7.97	7.43	7.09	6.72	6.72 / 11.01	
JHF-2	13.52	12.97	10.91	9.94	9.15	8.07	7.45	7.06	6.73	6.71 / 10.95	
JHF-3	13.57	13.16	10.99	9.98	9.15	8.03	7.49	7.09	6.74	6.82 / 11.13	
JHF-4	13.50	13.47	11.06	10.04	9.23	8.14	7.48	7.11	6.73	7.08 / 11.07	
JHF-5	13.91	13.91	11.70	10.19	9.30	8.15	7.55	7.22	6.74	7.38 / 11.47	
JHF-6	13.85	13.60	11.41	10.02	9.19	8.26	7.51	7.15	6.73	7.00 / 11.27	
JHF-7	13.44	12.56	10.49	9.59	8.83	8.09	7.48	7.05	6.70	6.31 / 10.79	
JHF-8	14.41	13.38	11.43	9.91	9.13	8.26	7.54	7.05	6.71	6.86 / 11.23	
JHF-9	13.65	12.78	10.69	9.60	8.77	7.96	7.50	7.09	6.65	6.27 / 10.88	
JHF-10	13.25	12.03	10.16	9.24	8.58	8.00	7.48	6.97	6.67	5.98 / 10.56	
JHF-11	14.02	12.77	10.54	9.49	8.79	8.16	7.54	7.04	6.70	6.34 / 11.04	
JHF-12	13.61	12.59	10.37	9.42	8.69	8.11	7.53	7.02	6.71	6.32 / 10.91	
JHF-13	13.77	12.47	10.30	9.42	8.59	8.02	7.51	7.00	6.68	6.25 / 10.99	
JHF-14	12.71	12.08	10.11	9.23	8.40	7.86	7.46	6.99	6.66	6.18 / 10.65	
JHF-15	14.10	13.50	11.13	9.89	8.99	8.25	7.65	7.03	6.72	7.18 / 11.64	
JHF-16	14.27	13.83	11.82	10.14	9.18	8.40	7.74	7.13	6.74	7.81 / 12.03	
JHF-17	14.10	13.49	11.35	9.93	8.97	8.26	7.72	7.19	6.74	7.29 / 11.82	
JHF-18	13.99	13.37	10.86	9.80	8.84	8.16	7.64	7.13	6.74	7.05 / 11.52	
JHF-19	13.62	12.70	10.48	9.43	8.69	7.94	7.56	7.04	6.70	6.51 / 10.79	
JHF-20	13.63	12.77	10.59	9.52	8.70	7.95	7.58	7.07	6.70	6.65 / 10.95	
JHF-21	13.81	13.11	10.83	9.67	8.79	8.02	7.57	7.11	6.73	6.88 / 11.30	
JHF-22	13.78	13.17	10.85	9.67	8.80	8.04	7.56	7.11	6.74	7.01 / 11.42	
JHF-23	14.50	13.88	11.10	9.96	8.96	8.16	7.64	7.15	6.79	7.54 / 11.93	
JHF-24	14.06	13.56	11.02	9.83	8.87	8.12	7.60	7.16	6.78	7.17 / 11.80	
JHF-25	14.16	13.64	10.88	9.80	8.85	8.13	7.60	7.13	6.78	7.18 / 11.66	
JHF-26	14.85	13.95	10.98	9.93	8.91	8.22	7.61	7.21	6.80	7.69 / 11.73	
JHF-27	14.38	13.85	10.85	9.82	8.88	8.19	7.63	7.15	6.81	7.04 / 11.54	
JHF-28	13.48	13.24	10.36	9.35	8.63	8.05	7.63	7.03	6.80	6.54 / 10.96	
JHF-29	13.22	12.98	10.28	9.26	8.54	8.04	7.63	7.04	6.81	6.47 / 10.76	
JHF-30	12.78	12.49	10.08	9.11	8.47	7.98	7.59	7.04	6.84	6.39 / 10.52	
JHF-31	12.69	12.17	9.82	9.01	8.37	7.91	7.53	7.04	6.84	6.36 / 10.32	
JHF-32	12.98	12.59	10.08	9.17	8.51	8.02	7.62	7.12	6.89	6.36 / 10.68	
JHF-33	12.65	12.06	9.82	9.05	8.37	7.90	7.53	7.11	6.89	6.27 / 10.40	
JHF-34	12.71	12.13	9.85	9.09	8.40	7.94	7.57	7.14	6.93	6.22 / 10.60	
JHF-35	10.98	10.38	9.07	8.42	7.90	7.84	7.35	7.07	6.90	5.82 / 9.70	
JHF-36	10.67	10.17	8.93	8.32	7.88	7.85	7.36	7.08	6.92	5.76 / 9.61	
JHF-37	10.67	10.21	8.96	8.35	7.92	7.86	7.39	7.11	6.97	5.76 / 9.65	
JHF-38	10.40	9.92	8.82	8.24	7.89	7.72	7.35	7.10	6.94	5.76 / 9.66	
GHLC-1	12.50	12.50	11.83	10.30	8.44	6.87	6.59	5.66	5.03	5.28 / 10.57	
GHLC-2	12.54	12.54	11.85	10.33	8.05	6.86	6.59	5.56	5.03	5.55 / 10.36	
GHLC-3	12.65	12.65	11.83	10.33	8.10	6.89	6.61	5.37	5.03	5.75 / 10.09	
GHLC-4	12.49	12.49	11.66	9.91	8.39	6.81	6.51	5.51	5.00	6.08 / 10.33	
GHLC-5	12.62	12.62	11.78	9.84	8.31	6.84	6.58	5.56	5.11	6.02 / 10.30	
GHLC-6	12.82	12.82	11.55	9.75	8.45	7.04	6.61	5.59	5.10	6.31 / 10.07	
GHLC-7	12.86	12.86	11.66	9.80	8.59	7.22	6.60	5.64	5.11	6.23 / 9.69	
GHLC-8	12.93	12.93	11.61	9.74	8.60	7.19	6.57	5.63	5.11	6.39 / 9.80	
GHLC-9	12.96	12.96	11.39	9.55	8.17	7.03	6.51	5.60	5.16	6.39 / 9.56	
GHLC-10	12.79	12.79	11.08	9.37	7.99	6.94	6.42	5.55	5.21	6.51 / 9.49	
GHLC-11	12.42	12.42	10.57	9.13	7.87	6.95	6.31	5.48	5.34	6.10 / 9.65	
GHLC-12	12.22	12.22	10.11	8.86	7.89	6.90	6.23	5.50	5.32	5.99 / 9.13	
GHLC-13	12.35	12.35	10.28	8.95	7.88	7.02	6.29	5.50	5.36	5.98 / 9.51	

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-14	12.42	12.41	10.42	9.02	7.90	7.00	6.32	5.52	5.39	5.90 /	9.23
GHLC-15	12.30	12.30	10.23	8.94	7.82	6.94	6.31	5.52	5.35	5.86 /	9.22
GHLC-16	12.24	12.24	10.14	8.90	7.84	6.96	6.27	5.54	5.34	5.97 /	9.24
GHLC-17	12.28	12.28	10.24	8.90	7.89	7.00	6.32	5.59	5.37	6.00 /	9.22
GHLC-18	12.16	12.06	10.14	8.86	7.85	7.05	6.27	5.63	5.36	6.02 /	9.07
GHLC-19	12.06	12.06	9.95	8.80	7.76	6.95	6.23	5.62	5.33	5.99 /	8.99
GHLC-20	11.98	11.98	9.87	8.77	7.80	7.03	6.32	5.73	5.35	5.70 /	9.05
GHLC-21	11.98	11.98	9.81	8.79	7.78	7.11	6.33	5.81	5.38	5.89 /	9.22
GHLC-22	12.21	12.21	10.16	8.96	7.86	7.19	6.31	5.77	5.45	5.97 /	9.43
GHLC-23	12.22	12.22	10.10	8.96	7.79	7.18	6.34	5.82	5.46	5.98 /	9.49
GHLC-24	12.17	12.17	10.01	8.95	7.79	7.21	6.44	5.88	5.51	5.86 /	9.57
GHLC-25	11.95	11.95	9.83	8.56	7.70	7.23	6.43	5.91	5.53	5.84 /	9.54
GHLC-26	11.65	11.65	9.51	8.57	7.68	7.09	6.40	5.84	5.43	5.57 /	9.13
GHLC-27	10.61	10.61	9.18	8.01	7.43	6.89	6.45	5.86	5.51	5.30 /	9.22
GHLC-28	11.52	11.52	9.50	8.17	7.54	7.13	6.39	5.89	5.51	5.59 /	9.28
GHLC-29	10.51	10.51	9.14	8.02	7.39	6.85	6.41	5.90	5.54	5.29 /	9.20
GHLC-30	10.31	10.31	8.90	8.08	7.39	6.86	6.39	5.90	5.58	5.39 /	9.21
GHLC-31	10.08	10.08	8.86	7.91	7.41	6.68	6.37	5.83	5.50	5.20 /	9.03
GHLC-32	9.96	9.71	8.66	7.86	7.30	6.68	6.27	5.74	5.52	5.04 /	8.92
GHLC-33	10.34	10.34	8.95	7.95	7.45	6.70	6.38	5.83	5.47	5.23 /	9.06
GHLC-34	10.36	10.07	8.61	7.83	7.26	6.62	6.28	5.71	5.52	5.12 /	8.83
GHLC-35	10.38	10.31	8.71	7.88	7.33	6.66	6.29	5.72	5.47	5.19 /	8.85
GHLC-36	11.18	10.75	9.03	8.05	7.52	6.89	6.45	5.89	5.56	5.39 /	9.07
GHLC-37	11.04	10.58	8.94	7.99	7.54	6.87	6.39	5.84	5.53	5.31 /	8.99
GHLC-38	11.69	10.87	9.20	8.13	7.55	7.00	6.51	5.91	5.50	5.45 /	9.19
GHLC-39	11.41	10.71	9.02	8.07	7.56	6.90	6.43	5.82	5.52	5.40 /	9.00
GHLC-40	12.00	11.38	9.44	8.28	7.71	7.09	6.44	5.96	5.54	5.81 /	9.34
GHLC-41	11.44	10.83	9.10	8.13	7.60	6.91	6.45	5.79	5.56	5.50 /	9.05
GHLC-42	12.00	11.15	9.43	8.35	7.71	7.11	6.39	5.87	5.60	5.93 /	9.29
GHLC-43	12.10	11.60	9.88	8.54	7.91	7.26	6.52	5.95	5.62	6.38 /	9.52
GHLC-44	13.16	12.40	10.74	8.85	8.15	7.37	6.63	6.08	5.66	6.71 /	9.87
GHLC-45	12.52	12.08	10.30	8.70	8.02	7.34	6.57	6.03	5.60	6.51 /	9.64
GHLC-46	13.04	12.19	10.40	8.75	8.07	7.38	6.71	6.07	5.64	6.56 /	9.66
GHLC-47	13.03	12.18	10.38	8.75	8.04	7.37	6.71	6.05	5.61	6.54 /	9.58
GHLC-48	12.60	11.50	9.43	8.45	7.76	7.07	6.51	5.83	5.59	5.90 /	9.16
GHLC-49	12.90	11.54	9.40	8.44	7.78	7.07	6.53	5.82	5.60	6.06 /	9.10
GHLC-50	12.51	12.37	10.33	8.79	7.98	7.38	6.77	6.01	5.63	6.49 /	9.67
GHLC-51	12.61	11.74	9.71	8.56	7.82	7.16	6.57	5.86	5.57	6.22 /	9.27
GHLC-52	12.68	11.37	9.32	8.33	7.86	6.95	6.46	5.75	5.58	5.90 /	9.00
GHLC-53	12.82	11.56	9.60	8.47	7.86	7.05	6.54	5.81	5.62	6.19 /	9.28
JHF-S1	12.23	12.23	10.68	9.62	8.27	6.88	6.50	5.57	5.34	6.78 /	9.76
JHF-S2	12.18	12.18	10.62	9.48	8.18	6.96	6.50	5.54	5.37	6.77 /	9.55
JHF-S3	12.26	12.26	10.67	9.40	8.14	7.02	6.49	5.57	5.39	6.82 /	9.64
JHF-S4	12.12	12.12	10.31	8.98	8.06	6.88	6.37	5.63	5.35	6.42 /	9.37
JHF-S5	11.99	11.99	9.91	8.78	7.96	6.78	6.27	5.69	5.30	6.16 /	9.10
JHF-S6	12.04	12.04	10.02	8.88	7.99	6.79	6.31	5.71	5.31	6.21 /	9.13
JHF-S7	12.09	12.09	9.94	8.85	7.99	6.77	6.31	5.69	5.29	6.18 /	9.06
JHF-S8	11.70	11.66	9.22	8.45	7.66	6.72	6.14	5.81	5.27	5.74 /	8.56
JHF-S9	11.71	11.68	9.23	8.39	7.67	6.72	6.14	5.79	5.25	5.75 /	8.54
JHF-S10	11.13	11.12	8.96	8.23	7.52	6.93	6.21	5.78	5.40	5.58 /	8.67
JHF-S11	11.61	11.61	9.40	8.50	7.66	7.17	6.32	5.92	5.53	5.95 /	9.24
JHF-S12	11.85	11.68	9.52	8.56	7.81	7.22	6.52	5.95	5.60	6.09 /	9.33
JHF-S13	7.64	7.64	7.58	7.12	6.37	5.38	4.84	4.48	3.73	2.83 /	8.69
JHF-S14	7.70	7.70	7.65	7.12	6.39	5.39	4.89	4.44	3.74	2.82 /	8.51
JHF-S15	7.72	7.72	7.69	7.12	6.44	5.42	4.86	4.46	3.75	2.81 /	8.48

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-S16	8.08	8.08	7.87	7.22	6.57	5.62	5.07	4.58	3.85	3.15 /	8.53
JHF-S17	8.07	8.07	7.85	7.22	6.54	5.63	5.02	4.50	3.91	3.10 /	8.38
JHF-S18	8.10	8.10	7.88	7.26	6.57	5.63	5.03	4.43	3.89	3.11 /	8.29
GHLC-S1	11.82	11.82	10.82	9.40	7.81	6.66	6.41	5.55	5.05	6.66 /	10.49
GHLC-S2	11.69	11.69	10.86	9.30	7.65	6.74	6.37	5.59	5.03	6.74 /	10.52
GHLC-S3	11.88	11.88	11.03	9.45	7.88	6.72	6.40	5.51	5.07	6.72 /	10.51
GHLC-S4	11.83	11.83	10.97	9.27	7.89	6.71	6.44	5.57	5.09	6.84 /	10.47
GHLC-S5	11.83	11.83	10.86	9.29	7.87	6.69	6.41	5.59	5.08	6.88 /	10.35
GHLC-S6	12.14	12.14	10.87	9.52	8.21	6.88	6.43	5.64	5.19	7.00 /	10.04
GHLC-S7	12.07	12.07	10.86	9.49	8.18	6.82	6.46	5.65	5.18	7.03 /	10.03
GHLC-S8	12.05	12.05	10.82	9.49	8.17	6.93	6.45	5.66	5.22	7.03 /	10.01
GHLC-S9	12.05	12.05	10.77	9.48	8.17	6.88	6.43	5.62	5.19	7.01 /	10.01
GHLC-S10	12.09	12.09	10.72	9.50	8.22	6.93	6.45	5.62	5.23	6.99 /	9.91

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。