

P S J 予測統計値  
(平均値)

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・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・パナソニック・キャピタル、UBS、メリルピッチ日本、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-1	13.54	12.73	11.22	9.90	8.83	8.04	7.43	6.79	6.50	6.72 / 11.01		
JHF-2	13.52	12.70	11.15	9.85	8.80	8.02	7.40	6.78	6.50	6.71 / 10.95		
JHF-3	13.64	12.81	11.27	9.95	8.86	8.06	7.45	6.81	6.52	6.82 / 11.13		
JHF-4	13.83	13.04	11.44	10.04	8.92	8.10	7.46	6.81	6.51	7.08 / 11.07		
JHF-5	14.28	13.38	11.79	10.31	9.11	8.22	7.59	6.86	6.55	7.38 / 11.47		
JHF-6	14.03	13.17	11.55	10.10	8.97	8.14	7.53	6.84	6.53	7.00 / 11.27		
JHF-7	13.20	12.40	10.87	9.62	8.63	7.92	7.35	6.77	6.50	6.31 / 10.79		
JHF-8	13.99	13.10	11.45	10.02	8.92	8.12	7.49	6.83	6.54	6.86 / 11.23		
JHF-9	13.37	12.55	11.01	9.64	8.67	7.96	7.38	6.79	6.52	6.27 / 10.88		
JHF-10	12.78	12.03	10.54	9.36	8.46	7.81	7.27	6.75	6.50	5.98 / 10.56		
JHF-11	13.36	12.60	10.98	9.68	8.68	7.96	7.39	6.81	6.54	6.34 / 11.04		
JHF-12	13.21	12.48	10.88	9.58	8.62	7.90	7.35	6.79	6.53	6.32 / 10.91		
JHF-13	13.09	12.34	10.82	9.52	8.58	7.89	7.34	6.80	6.54	6.25 / 10.99		
JHF-14	12.74	12.06	10.52	9.30	8.46	7.78	7.27	6.77	6.53	6.18 / 10.65		
JHF-15	14.20	13.36	11.68	10.19	9.00	8.16	7.53	6.88	6.60	7.18 / 11.64		
JHF-16	14.80	13.92	12.16	10.57	9.28	8.34	7.66	6.93	6.62	7.81 / 12.03		
JHF-17	14.35	13.51	11.83	10.28	9.08	8.25	7.62	6.95	6.65	7.29 / 11.82		
JHF-18	14.05	13.26	11.52	10.06	8.93	8.15	7.53	6.90	6.62	7.05 / 11.52		
JHF-19	13.23	12.50	10.84	9.51	8.61	7.93	7.39	6.84	6.58	6.51 / 10.79		
JHF-20	13.37	12.65	10.97	9.63	8.67	7.98	7.43	6.88	6.61	6.65 / 10.95		
JHF-21	13.84	13.07	11.30	9.87	8.81	8.07	7.50	6.90	6.64	6.88 / 11.30		
JHF-22	13.94	13.11	11.38	9.90	8.84	8.08	7.51	6.93	6.67	7.01 / 11.42		
JHF-23	14.70	13.82	11.91	10.30	9.12	8.25	7.65	6.99	6.70	7.54 / 11.93		
JHF-24	14.35	13.47	11.65	10.10	8.98	8.18	7.60	6.98	6.70	7.17 / 11.80		
JHF-25	14.35	13.52	11.59	10.04	8.96	8.18	7.59	6.98	6.70	7.18 / 11.66		
JHF-26	14.85	13.97	11.95	10.30	9.11	8.28	7.66	7.02	6.72	7.69 / 11.73		
JHF-27	14.39	13.51	11.64	10.09	8.96	8.20	7.61	7.00	6.73	7.04 / 11.54		
JHF-28	13.53	12.70	10.91	9.53	8.66	8.01	7.47	6.95	6.70	6.54 / 10.96		
JHF-29	13.31	12.50	10.73	9.45	8.61	7.96	7.46	6.97	6.72	6.47 / 10.76		
JHF-30	12.95	12.16	10.45	9.28	8.51	7.90	7.43	6.97	6.73	6.39 / 10.52		
JHF-31	12.75	11.99	10.31	9.15	8.45	7.85	7.41	6.97	6.73	6.36 / 10.32		
JHF-32	13.08	12.32	10.59	9.35	8.58	7.96	7.49	7.02	6.78	6.36 / 10.68		
JHF-33	12.71	11.98	10.32	9.19	8.46	7.88	7.45	7.01	6.77	6.27 / 10.40		
JHF-34	12.79	12.03	10.35	9.23	8.51	7.92	7.49	7.05	6.82	6.22 / 10.60		
JHF-35	11.49	10.80	9.44	8.59	8.05	7.61	7.30	6.95	6.75	5.82 / 9.70		
JHF-36	11.30	10.66	9.26	8.49	7.97	7.57	7.27	6.93	6.73	5.76 / 9.61		
JHF-37	11.34	10.70	9.27	8.49	7.98	7.58	7.28	6.94	6.74	5.76 / 9.65		
JHF-38	11.10	10.42	9.08	8.34	7.90	7.52	7.24	6.91	6.72	5.76 / 9.66		
GHLC-1	12.35	11.76	11.10	9.84	8.44	7.19	6.27	5.25	4.80	5.28 / 10.57		
GHLC-2	12.50	11.80	11.05	9.81	8.38	7.16	6.27	5.28	4.86	5.55 / 10.36		
GHLC-3	12.50	11.83	11.04	9.70	8.32	7.10	6.25	5.31	4.91	5.75 / 10.09		
GHLC-4	12.55	11.91	11.16	9.74	8.33	7.11	6.30	5.39	5.00	6.08 / 10.33		
GHLC-5	12.57	11.93	11.20	9.78	8.32	7.15	6.33	5.45	5.08	6.02 / 10.30		
GHLC-6	12.60	12.06	11.22	9.80	8.32	7.18	6.37	5.51	5.15	6.31 / 10.07		
GHLC-7	12.60	12.01	11.14	9.69	8.23	7.12	6.33	5.49	5.12	6.23 / 9.69		
GHLC-8	12.60	12.02	11.17	9.69	8.24	7.13	6.37	5.54	5.17	6.39 / 9.80		
GHLC-9	12.42	11.86	11.00	9.47	8.08	7.01	6.29	5.50	5.17	6.39 / 9.56		
GHLC-10	12.36	11.82	10.85	9.30	7.96	6.93	6.25	5.49	5.18	6.51 / 9.49		
GHLC-11	12.14	11.66	10.63	9.14	7.78	6.85	6.23	5.50	5.23	6.10 / 9.65		
GHLC-12	12.03	11.47	10.37	8.86	7.61	6.76	6.19	5.52	5.26	5.99 / 9.13		
GHLC-13	12.08	11.57	10.50	8.98	7.68	6.80	6.20	5.53	5.27	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	12.11	11.56	10.53	9.06	7.74	6.84	6.23	5.53	5.26	5.90 /	9.23
GHLC-15	12.09	11.56	10.44	8.98	7.69	6.82	6.22	5.53	5.26	5.86 /	9.22
GHLC-16	12.13	11.52	10.44	8.95	7.67	6.81	6.21	5.54	5.28	5.97 /	9.24
GHLC-17	12.10	11.57	10.46	8.99	7.69	6.85	6.25	5.57	5.32	6.00 /	9.22
GHLC-18	12.08	11.52	10.44	8.89	7.71	6.84	6.26	5.59	5.33	6.02 /	9.07
GHLC-19	12.03	11.50	10.30	8.87	7.66	6.81	6.23	5.57	5.32	5.99 /	8.99
GHLC-20	12.10	11.54	10.37	8.87	7.71	6.90	6.29	5.63	5.38	5.70 /	9.05
GHLC-21	12.14	11.54	10.32	8.90	7.74	6.92	6.33	5.68	5.42	5.89 /	9.22
GHLC-22	12.25	11.70	10.49	8.98	7.80	6.95	6.35	5.68	5.42	5.97 /	9.43
GHLC-23	12.34	11.75	10.48	9.01	7.84	6.99	6.38	5.71	5.44	5.98 /	9.49
GHLC-24	12.28	11.74	10.45	8.96	7.84	7.03	6.41	5.75	5.48	5.86 /	9.57
GHLC-25	12.17	11.57	10.24	8.81	7.76	7.00	6.40	5.76	5.49	5.84 /	9.54
GHLC-26	11.93	11.34	10.06	8.62	7.61	6.87	6.30	5.69	5.44	5.57 /	9.13
GHLC-27	11.24	10.67	9.41	8.31	7.42	6.75	6.22	5.69	5.46	5.30 /	9.22
GHLC-28	11.87	11.30	9.90	8.57	7.59	6.86	6.30	5.71	5.46	5.59 /	9.28
GHLC-29	11.13	10.57	9.29	8.26	7.38	6.72	6.20	5.70	5.46	5.29 /	9.20
GHLC-30	11.02	10.43	9.22	8.21	7.36	6.69	6.18	5.69	5.46	5.39 /	9.21
GHLC-31	10.82	10.22	9.05	8.03	7.26	6.62	6.14	5.67	5.44	5.20 /	9.03
GHLC-32	10.61	10.05	8.90	7.93	7.18	6.58	6.12	5.67	5.46	5.04 /	8.92
GHLC-33	10.94	10.38	9.14	8.13	7.31	6.67	6.17	5.69	5.46	5.23 /	9.06
GHLC-34	10.66	10.12	8.92	7.96	7.20	6.57	6.13	5.68	5.45	5.12 /	8.83
GHLC-35	10.81	10.20	8.99	8.04	7.24	6.60	6.14	5.69	5.46	5.19 /	8.85
GHLC-36	11.32	10.71	9.40	8.30	7.45	6.74	6.23	5.72	5.48	5.39 /	9.07
GHLC-37	11.21	10.59	9.26	8.25	7.37	6.69	6.20	5.70	5.47	5.31 /	8.99
GHLC-38	11.60	10.90	9.58	8.42	7.52	6.80	6.27	5.72	5.48	5.45 /	9.19
GHLC-39	11.37	10.72	9.42	8.34	7.44	6.75	6.22	5.71	5.46	5.40 /	9.00
GHLC-40	11.94	11.24	9.89	8.65	7.66	6.90	6.33	5.75	5.49	5.81 /	9.34
GHLC-41	11.48	10.81	9.51	8.39	7.49	6.80	6.24	5.73	5.48	5.50 /	9.05
GHLC-42	11.94	11.26	9.86	8.66	7.66	6.91	6.32	5.75	5.49	5.93 /	9.29
GHLC-43	12.36	11.62	10.21	8.92	7.85	7.04	6.42	5.79	5.52	6.38 /	9.52
GHLC-44	13.09	12.27	10.77	9.35	8.17	7.25	6.57	5.85	5.55	6.71 /	9.87
GHLC-45	12.82	12.04	10.54	9.13	8.01	7.15	6.49	5.81	5.52	6.51 /	9.64
GHLC-46	13.01	12.21	10.65	9.25	8.07	7.20	6.53	5.83	5.54	6.56 /	9.66
GHLC-47	13.07	12.23	10.65	9.22	8.08	7.21	6.57	5.84	5.55	6.54 /	9.58
GHLC-48	12.34	11.58	10.09	8.77	7.74	6.98	6.42	5.79	5.51	5.90 /	9.16
GHLC-49	12.41	11.64	10.07	8.76	7.75	6.99	6.41	5.79	5.52	6.06 /	9.10
GHLC-50	13.06	12.28	10.65	9.20	8.07	7.20	6.56	5.84	5.54	6.49 /	9.67
GHLC-51	12.65	11.87	10.27	8.88	7.84	7.04	6.45	5.80	5.52	6.22 /	9.27
GHLC-52	12.29	11.50	9.96	8.66	7.69	6.94	6.36	5.77	5.50	5.90 /	9.00
GHLC-53	12.54	11.78	10.18	8.82	7.81	7.03	6.43	5.80	5.52	6.19 /	9.28
JHF-S1	12.33	11.80	10.86	9.58	8.31	7.21	6.42	5.52	5.13	6.78 /	9.76
JHF-S2	12.27	11.71	10.81	9.58	8.27	7.18	6.39	5.50	5.12	6.77 /	9.55
JHF-S3	12.27	11.72	10.77	9.58	8.27	7.18	6.39	5.51	5.12	6.82 /	9.64
JHF-S4	12.13	11.59	10.62	9.30	8.03	7.02	6.32	5.53	5.20	6.42 /	9.37
JHF-S5	11.98	11.43	10.38	9.09	7.83	6.87	6.25	5.50	5.21	6.16 /	9.10
JHF-S6	12.04	11.51	10.48	9.14	7.89	6.92	6.28	5.53	5.23	6.21 /	9.13
JHF-S7	12.04	11.51	10.46	9.12	7.86	6.90	6.26	5.51	5.22	6.18 /	9.06
JHF-S8	11.66	11.19	10.06	8.65	7.49	6.72	6.18	5.56	5.31	5.74 /	8.56
JHF-S9	11.68	11.18	10.03	8.66	7.49	6.72	6.18	5.55	5.31	5.75 /	8.54
JHF-S10	11.57	11.01	9.77	8.46	7.45	6.76	6.24	5.67	5.43	5.58 /	8.67
JHF-S11	12.03	11.47	10.11	8.73	7.68	6.92	6.34	5.74	5.48	5.95 /	9.24
JHF-S12	12.21	11.61	10.25	8.82	7.76	6.98	6.39	5.77	5.51	6.09 /	9.33
JHF-S13	7.65	7.52	6.97	6.27	5.58	5.01	4.58	4.07	3.78	2.83 /	8.69
JHF-S14	7.63	7.48	6.95	6.28	5.55	4.99	4.56	4.04	3.75	2.82 /	8.51
JHF-S15	7.68	7.44	6.98	6.27	5.57	4.99	4.57	4.04	3.77	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	8.14	7.94	7.38	6.70	5.91	5.26	4.80	4.17	3.91	3.15 /	8.53
JHF-S17	8.11	7.94	7.41	6.64	5.89	5.25	4.78	4.16	3.90	3.10 /	8.38
JHF-S18	8.09	7.93	7.35	6.63	5.90	5.26	4.79	4.16	3.91	3.11 /	8.29
GHLC-S1	12.09	11.49	10.62	9.48	8.25	7.15	6.30	5.32	4.88	6.66 /	10.49
GHLC-S2	12.00	11.37	10.57	9.41	8.19	7.11	6.28	5.32	4.88	6.74 /	10.52
GHLC-S3	12.06	11.44	10.60	9.43	8.24	7.16	6.29	5.34	4.91	6.72 /	10.51
GHLC-S4	12.24	11.58	10.75	9.54	8.28	7.18	6.35	5.41	5.00	6.84 /	10.47
GHLC-S5	12.18	11.56	10.67	9.51	8.26	7.15	6.33	5.40	4.99	6.88 /	10.35
GHLC-S6	12.32	11.72	10.84	9.64	8.37	7.24	6.42	5.48	5.07	7.00 /	10.04
GHLC-S7	12.31	11.70	10.88	9.63	8.36	7.23	6.41	5.47	5.07	7.03 /	10.03
GHLC-S8	12.30	11.70	10.85	9.64	8.37	7.24	6.42	5.48	5.08	7.03 /	10.01
GHLC-S9	12.28	11.72	10.81	9.63	8.35	7.23	6.40	5.48	5.07	7.01 /	10.01
GHLC-S10	12.30	11.68	10.82	9.59	8.35	7.22	6.40	5.47	5.06	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。