

P S J 予測統計値
(中央値)

2010年 9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	13.94	13.18	11.80	10.30	9.27	8.21	7.44	7.17	6.77	7.13 / 11.44		
JHF-2	13.71	13.01	11.71	10.12	9.28	8.17	7.43	7.18	6.79	7.06 / 11.41		
JHF-3	14.24	13.26	11.88	10.30	9.29	8.17	7.48	7.19	6.81	7.37 / 11.56		
JHF-4	13.88	13.42	12.03	10.35	9.41	8.30	7.49	7.17	6.80	7.70 / 11.50		
JHF-5	13.88	13.88	12.35	10.34	9.43	8.32	7.54	7.21	6.82	7.99 / 11.95		
JHF-6	14.56	13.67	12.13	10.29	9.50	8.41	7.56	7.18	6.86	7.52 / 11.75		
JHF-7	13.64	12.97	11.24	9.90	9.15	8.16	7.56	7.07	6.74	6.59 / 11.21		
JHF-8	14.50	13.74	11.96	10.20	9.42	8.33	7.67	7.14	6.83	7.36 / 11.71		
JHF-9	13.76	13.02	11.44	9.94	9.19	8.21	7.62	7.09	6.75	6.69 / 11.31		
JHF-10	13.16	12.97	11.05	9.64	8.81	8.19	7.54	7.04	6.70	6.33 / 11.00		
JHF-11	13.70	13.49	11.36	9.89	9.15	8.29	7.57	7.06	6.77	6.60 / 11.49		
JHF-12	13.92	13.36	11.24	9.81	9.08	8.23	7.55	7.06	6.74	6.65 / 11.33		
JHF-13	13.83	13.00	11.05	9.75	9.04	8.22	7.57	7.02	6.73	6.53 / 11.44		
JHF-14	12.58	12.58	10.71	9.58	8.58	8.12	7.53	7.00	6.69	6.41 / 11.05		
JHF-15	14.20	13.88	11.90	10.24	9.41	8.40	7.67	7.11	6.84	7.76 / 12.12		
JHF-16	14.69	14.33	12.40	10.53	9.64	8.59	7.76	7.15	6.90	8.12 / 12.53		
JHF-17	14.17	14.06	12.16	10.37	9.41	8.57	7.81	7.19	6.89	7.79 / 12.29		
JHF-18	14.05	13.93	11.87	10.13	9.22	8.45	7.72	7.15	6.84	7.58 / 11.98		
JHF-19	13.68	12.98	11.11	9.69	8.79	8.10	7.59	7.09	6.72	6.82 / 11.20		
JHF-20	13.68	13.19	11.26	9.74	8.83	8.13	7.60	7.10	6.74	7.04 / 11.38		
JHF-21	13.82	13.47	11.65	9.87	8.99	8.24	7.67	7.15	6.77	7.38 / 11.74		
JHF-22	13.78	13.51	11.65	9.86	8.97	8.23	7.66	7.12	6.77	7.46 / 11.86		
JHF-23	14.43	14.17	12.34	10.16	9.19	8.27	7.78	7.13	6.85	8.06 / 12.38		
JHF-24	14.00	13.75	11.99	9.99	9.12	8.31	7.74	7.17	6.82	7.62 / 12.24		
JHF-25	14.05	13.81	12.00	9.97	8.97	8.28	7.71	7.19	6.80	7.57 / 12.11		
JHF-26	14.75	14.12	12.56	10.18	9.14	8.34	7.78	7.11	6.84	8.14 / 12.19		
JHF-27	14.29	13.80	11.97	10.03	9.03	8.23	7.74	7.11	6.82	7.58 / 11.99		
JHF-28	13.51	13.17	10.89	9.60	8.73	8.08	7.72	7.20	6.79	6.84 / 11.35		
JHF-29	13.43	12.92	10.60	9.53	8.67	8.06	7.72	7.17	6.80	6.70 / 11.13		
JHF-30	13.20	12.44	10.36	9.39	8.57	8.02	7.73	7.13	6.82	6.72 / 10.89		
JHF-31	12.70	12.18	10.26	9.28	8.48	7.99	7.71	7.09	6.83	6.52 / 10.69		
JHF-32	13.30	12.53	10.60	9.44	8.62	8.07	7.78	7.19	6.87	6.61 / 11.06		
JHF-33	12.60	12.01	10.18	9.28	8.51	8.01	7.75	7.14	6.87	6.43 / 10.74		
JHF-34	12.70	12.07	10.24	9.32	8.57	8.06	7.76	7.15	6.91	6.43 / 10.94		
JHF-35	11.92	10.34	9.05	8.60	8.09	7.83	7.36	7.05	6.87	6.05 / 9.69		
JHF-36	11.66	10.21	8.97	8.48	8.06	7.84	7.35	7.06	6.89	6.00 / 9.60		
JHF-37	11.72	10.18	9.02	8.49	8.08	7.83	7.39	7.10	6.92	6.05 / 9.66		
JHF-38	11.36	9.96	8.86	8.37	8.02	7.82	7.37	7.10	6.93	5.92 / 9.66		
JHF-39	10.90	9.72	8.72	8.30	7.99	7.83	7.37	7.12	6.97	5.77 / 9.59		
JHF-40	10.47	9.41	8.59	8.15	7.82	7.70	7.33	7.09	6.95	5.67 / 9.53		
GHLC-1	12.55	12.55	12.31	10.74	9.28	7.03	6.59	5.68	5.10	5.00 / 11.02		
GHLC-2	12.57	12.57	12.32	10.70	8.78	7.20	6.58	5.74	5.07	5.40 / 10.79		
GHLC-3	12.67	12.67	12.41	10.63	8.50	7.10	6.59	5.68	5.06	5.63 / 10.56		
GHLC-4	12.46	12.46	11.99	10.38	9.14	7.47	6.53	5.65	5.07	5.93 / 10.73		
GHLC-5	12.55	12.55	12.05	10.41	8.77	7.15	6.57	5.68	5.10	5.90 / 10.73		
GHLC-6	12.73	12.73	11.94	10.22	8.85	7.35	6.61	5.70	5.11	6.23 / 10.45		
GHLC-7	12.80	12.80	12.10	10.37	9.00	7.50	6.64	5.68	5.10	6.15 / 10.08		
GHLC-8	12.85	12.85	12.00	10.16	8.95	7.47	6.69	5.70	5.12	6.31 / 10.16		
GHLC-9	12.95	12.95	11.89	9.93	8.71	7.28	6.63	5.63	5.12	6.31 / 10.10		
GHLC-10	12.74	12.74	11.57	9.72	8.60	7.18	6.55	5.58	5.17	6.46 / 9.85		
GHLC-11	12.39	12.39	11.05	9.43	8.22	7.05	6.42	5.51	5.27	6.59 / 9.97		

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-12	12.15	12.15	10.60	9.15	8.08	7.07	6.32	5.51	5.35	6.25 / 9.40		
GHLC-13	12.29	12.29	10.78	9.26	8.06	7.11	6.40	5.52	5.32	6.08 / 10.00		
GHLC-14	12.40	12.40	10.91	9.33	8.08	7.17	6.42	5.55	5.32	6.42 / 9.81		
GHLC-15	12.24	12.24	10.70	9.22	8.01	7.11	6.38	5.51	5.40	6.34 / 9.72		
GHLC-16	12.20	12.20	10.74	9.21	8.20	7.08	6.37	5.51	5.44	6.07 / 9.74		
GHLC-17	12.18	12.18	10.70	9.22	8.08	7.08	6.37	5.52	5.42	6.06 / 9.68		
GHLC-18	12.10	12.10	10.66	9.17	8.03	7.06	6.38	5.58	5.48	6.42 / 9.51		
GHLC-19	12.03	12.03	10.45	9.08	7.95	7.05	6.34	5.60	5.47	6.29 / 9.39		
GHLC-20	11.97	11.97	10.36	9.04	8.00	7.09	6.40	5.77	5.50	6.12 / 9.52		
GHLC-21	11.93	11.93	10.35	9.07	8.00	7.16	6.38	5.77	5.54	6.33 / 9.52		
GHLC-22	12.14	12.14	10.71	9.22	8.06	7.21	6.40	5.72	5.58	6.32 / 9.87		
GHLC-23	12.14	12.14	10.62	9.22	7.99	7.20	6.43	5.79	5.57	6.31 / 9.82		
GHLC-24	12.07	12.07	10.54	9.20	8.00	7.23	6.48	5.86	5.60	6.21 / 9.84		
GHLC-25	11.86	11.86	10.28	9.08	7.92	7.25	6.61	6.00	5.58	6.13 / 9.68		
GHLC-26	11.60	11.60	9.80	8.86	7.91	7.15	6.52	5.85	5.45	6.05 / 9.25		
GHLC-27	10.98	10.51	9.40	8.08	7.60	7.07	6.46	5.97	5.53	5.59 / 9.30		
GHLC-28	11.40	11.40	9.76	8.81	7.78	7.24	6.50	5.93	5.52	5.81 / 9.35		
GHLC-29	10.81	10.38	9.35	8.08	7.56	7.07	6.43	5.97	5.54	5.42 / 9.31		
GHLC-30	10.28	10.25	9.34	8.12	7.57	7.13	6.40	5.97	5.57	5.52 / 9.34		
GHLC-31	10.34	9.97	9.10	8.00	7.42	6.91	6.47	5.85	5.50	5.35 / 9.14		
GHLC-32	10.25	9.64	8.95	7.90	7.43	6.76	6.39	5.82	5.51	5.24 / 9.03		
GHLC-33	10.48	10.26	9.17	8.02	7.52	6.91	6.49	5.87	5.44	5.46 / 9.20		
GHLC-34	10.34	10.03	8.98	7.94	7.47	6.77	6.35	5.81	5.49	5.24 / 8.97		
GHLC-35	10.37	10.22	8.97	7.93	7.49	6.83	6.40	5.78	5.45	5.33 / 8.98		
GHLC-36	11.04	10.74	9.30	8.16	7.65	7.03	6.48	5.90	5.55	5.57 / 9.22		
GHLC-37	10.93	10.78	9.18	8.14	7.63	7.03	6.49	5.85	5.53	5.51 / 9.15		
GHLC-38	11.60	11.24	9.47	8.36	7.74	7.21	6.55	5.95	5.52	5.81 / 9.36		
GHLC-39	11.33	11.18	9.30	8.27	7.69	7.12	6.52	5.88	5.55	5.63 / 9.19		
GHLC-40	11.91	11.41	9.70	8.45	7.84	7.31	6.52	5.99	5.53	6.09 / 9.50		
GHLC-41	11.35	11.25	9.37	8.26	7.74	7.15	6.53	5.88	5.55	5.74 / 9.23		
GHLC-42	11.89	11.54	9.78	8.46	7.88	7.33	6.47	6.00	5.61	6.25 / 9.51		
GHLC-43	12.46	12.15	10.35	8.66	8.03	7.49	6.66	6.09	5.61	6.68 / 9.72		
GHLC-44	13.29	12.62	11.14	9.17	8.27	7.50	6.65	6.17	5.65	7.08 / 10.08		
GHLC-45	13.27	12.33	10.83	8.99	8.16	7.57	6.81	6.13	5.59	6.86 / 9.86		
GHLC-46	12.85	12.34	10.76	9.14	8.26	7.56	6.92	6.14	5.64	6.90 / 10.05		
GHLC-47	12.86	12.36	10.89	9.18	8.27	7.60	6.91	6.14	5.57	6.88 / 10.00		
GHLC-48	12.84	11.89	9.92	8.72	7.93	7.29	6.65	5.95	5.59	6.25 / 9.51		
GHLC-49	12.76	12.38	9.90	8.70	7.95	7.27	6.66	5.93	5.59	6.41 / 9.55		
GHLC-50	13.49	12.39	10.81	9.15	8.27	7.62	6.89	6.12	5.65	6.83 / 10.15		
GHLC-51	12.64	12.16	10.24	8.82	8.08	7.38	6.72	5.98	5.58	6.52 / 9.70		
GHLC-52	12.73	11.97	9.77	8.61	7.81	7.18	6.58	5.88	5.60	6.24 / 9.43		
GHLC-53	13.08	11.69	10.07	8.73	7.94	7.29	6.63	5.95	5.65	6.45 / 9.71		
JHF-S1	12.23	12.23	11.05	10.06	8.62	7.39	6.48	5.62	5.27	7.16 / 10.13		
JHF-S2	12.22	12.22	10.98	10.06	8.62	7.32	6.48	5.62	5.30	7.17 / 10.00		
JHF-S3	12.26	12.26	10.98	9.91	8.63	7.21	6.49	5.62	5.34	7.19 / 10.05		
JHF-S4	12.08	12.08	10.66	9.25	8.33	7.05	6.50	5.67	5.49	6.90 / 9.81		
JHF-S5	11.93	11.93	10.34	9.05	8.24	6.97	6.39	5.69	5.45	6.59 / 9.58		
JHF-S6	11.98	11.98	10.41	9.10	8.29	7.00	6.38	5.67	5.47	6.67 / 9.60		
JHF-S7	12.02	12.02	10.36	9.07	8.23	7.02	6.39	5.65	5.45	6.63 / 9.53		
JHF-S8	11.67	11.67	9.55	8.67	7.92	6.85	6.20	5.82	5.37	6.09 / 9.00		
JHF-S9	11.69	11.69	9.57	8.63	7.89	6.86	6.22	5.83	5.37	6.11 / 9.01		
JHF-S10	11.12	11.12	9.23	8.51	7.55	7.08	6.28	5.95	5.42	5.86 / 8.84		
JHF-S11	12.14	11.44	9.66	8.78	7.91	7.40	6.42	6.07	5.57	6.23 / 9.53		
JHF-S12	12.07	11.80	9.91	8.86	8.06	7.34	6.68	6.14	5.59	6.39 / 9.70		
JHF-S13	7.52	7.52	7.50	7.10	6.44	5.45	4.90	4.51	3.74	2.90 / 9.06		

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-S14	7.59	7.59	7.57	7.12	6.47	5.50	4.87	4.47	3.75	2.88 / 8.91
JHF-S15	7.63	7.63	7.61	7.15	6.47	5.54	4.92	4.52	3.79	2.87 / 8.84
JHF-S16	7.99	7.98	7.87	7.25	6.65	5.72	5.08	4.65	3.90	3.24 / 8.91
JHF-S17	8.01	7.96	7.81	7.30	6.67	5.65	5.03	4.60	3.92	3.18 / 8.74
JHF-S18	7.99	7.98	7.86	7.29	6.67	5.69	5.08	4.61	3.90	3.17 / 8.65
GHLC-S1	11.76	11.76	11.29	9.80	8.39	7.14	6.41	5.71	5.07	6.59 / 10.75
GHLC-S2	11.72	11.72	11.11	9.73	8.07	6.81	6.37	5.61	5.07	6.66 / 10.89
GHLC-S3	11.82	11.82	11.24	9.75	8.29	7.00	6.39	5.64	5.10	6.64 / 10.86
GHLC-S4	11.83	11.83	11.23	9.75	8.48	7.04	6.45	5.72	5.13	6.74 / 10.85
GHLC-S5	11.77	11.77	11.16	9.73	8.48	7.04	6.40	5.72	5.10	6.81 / 10.77
GHLC-S6	12.15	12.15	11.15	9.92	8.74	7.68	6.45	5.67	5.14	6.96 / 10.42
GHLC-S7	12.11	12.11	11.19	9.94	8.71	7.62	6.44	5.70	5.12	6.96 / 10.42
GHLC-S8	12.03	12.03	11.10	9.89	8.70	7.58	6.44	5.74	5.13	7.04 / 10.39
GHLC-S9	12.08	12.08	11.08	9.92	8.70	7.50	6.45	5.71	5.13	7.04 / 10.36
GHLC-S10	12.06	12.06	11.05	9.89	8.67	7.51	6.44	5.73	5.16	7.07 / 10.28

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。