

P S J 予測統計値
(平均値)

2010年 5月 17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	13.36	12.50	10.61	9.33	8.43	7.75	7.21	6.69	6.43	6.22 / 10.37	
JHF-2	13.33	12.46	10.52	9.31	8.40	7.72	7.20	6.69	6.43	6.18 / 10.31	
JHF-3	13.49	12.62	10.68	9.35	8.46	7.77	7.24	6.71	6.46	6.34 / 10.49	
JHF-4	13.72	12.80	10.80	9.44	8.51	7.80	7.25	6.72	6.46	6.57 / 10.43	
JHF-5	14.09	13.20	11.11	9.69	8.66	7.92	7.35	6.76	6.48	6.83 / 10.79	
JHF-6	13.84	12.95	10.85	9.48	8.54	7.84	7.30	6.74	6.46	6.52 / 10.60	
JHF-7	13.00	12.19	10.25	9.09	8.25	7.64	7.15	6.67	6.43	5.89 / 10.15	
JHF-8	13.78	12.87	10.76	9.41	8.49	7.80	7.27	6.73	6.48	6.31 / 10.54	
JHF-9	13.17	12.37	10.35	9.11	8.30	7.68	7.19	6.70	6.46	5.96 / 10.21	
JHF-10	12.61	11.80	10.00	8.90	8.13	7.54	7.11	6.67	6.43	5.72 / 9.95	
JHF-11	13.14	12.33	10.36	9.17	8.31	7.68	7.20	6.72	6.47	6.00 / 10.38	
JHF-12	13.02	12.20	10.30	9.05	8.26	7.63	7.17	6.71	6.47	6.00 / 10.29	
JHF-13	12.86	12.07	10.19	9.02	8.22	7.60	7.16	6.71	6.47	5.86 / 10.36	
JHF-14	12.59	11.77	9.93	8.81	8.12	7.51	7.12	6.69	6.46	5.80 / 10.06	
JHF-15	14.02	13.15	10.97	9.55	8.57	7.84	7.33	6.79	6.54	6.61 / 10.97	
JHF-16	14.65	13.72	11.41	9.92	8.79	8.01	7.43	6.84	6.56	7.46 / 11.29	
JHF-17	14.18	13.33	11.11	9.61	8.65	7.95	7.40	6.84	6.59	6.71 / 11.09	
JHF-18	13.85	13.00	10.84	9.43	8.52	7.85	7.32	6.81	6.55	6.59 / 10.81	
JHF-19	13.01	12.23	10.22	8.99	8.25	7.65	7.20	6.76	6.52	6.14 / 10.15	
JHF-20	13.24	12.41	10.34	9.09	8.32	7.70	7.25	6.80	6.55	6.24 / 10.30	
JHF-21	13.70	12.86	10.61	9.30	8.44	7.79	7.30	6.83	6.58	6.48 / 10.64	
JHF-22	13.73	12.91	10.63	9.34	8.46	7.79	7.33	6.85	6.61	6.57 / 10.75	
JHF-23	14.47	13.57	11.18	9.68	8.67	7.94	7.44	6.91	6.65	6.96 / 11.22	
JHF-24	14.11	13.26	10.90	9.48	8.56	7.88	7.39	6.89	6.64	6.61 / 11.10	
JHF-25	14.14	13.22	10.82	9.44	8.55	7.87	7.39	6.89	6.64	6.60 / 10.99	
JHF-26	14.65	13.67	11.19	9.66	8.68	7.96	7.45	6.93	6.66	6.97 / 11.04	
JHF-27	14.19	13.31	10.89	9.44	8.57	7.91	7.43	6.93	6.68	6.63 / 10.88	
JHF-28	13.36	12.47	10.24	9.04	8.34	7.76	7.33	6.89	6.65	6.30 / 10.36	
JHF-29	13.10	12.27	10.09	8.97	8.30	7.72	7.32	6.90	6.67	6.22 / 10.18	
JHF-30	12.75	11.96	9.90	8.86	8.22	7.67	7.30	6.90	6.67	6.18 / 9.93	
JHF-31	12.55	11.72	9.78	8.79	8.17	7.64	7.29	6.91	6.69	6.07 / 9.78	
JHF-32	12.89	12.08	9.95	8.93	8.28	7.72	7.36	6.96	6.74	6.13 / 10.10	
JHF-33	12.52	11.73	9.74	8.78	8.20	7.67	7.33	6.96	6.73	6.05 / 9.86	
JHF-34	12.58	11.80	9.85	8.83	8.24	7.71	7.38	7.00	6.78	6.05 / 10.03	
JHF-35	11.35	10.56	9.00	8.33	7.86	7.47	7.22	6.90	6.71	5.67 / 9.62	
JHF-36	11.12	10.39	8.91	8.21	7.79	7.43	7.18	6.88	6.69	5.60 / 9.55	
GHLC-1	12.21	11.62	10.56	9.12	7.85	6.79	6.00	5.14	4.77	5.47 / 9.90	
GHLC-2	12.31	11.68	10.58	9.12	7.79	6.75	6.00	5.18	4.83	5.69 / 9.71	
GHLC-3	12.27	11.65	10.55	9.08	7.74	6.71	6.01	5.21	4.88	5.65 / 9.54	
GHLC-4	12.35	11.75	10.59	9.02	7.71	6.70	6.04	5.28	4.97	5.97 / 9.75	
GHLC-5	12.33	11.77	10.57	9.02	7.72	6.73	6.08	5.34	5.04	6.17 / 9.74	
GHLC-6	12.43	11.84	10.60	9.06	7.73	6.76	6.12	5.40	5.10	6.19 / 9.55	
GHLC-7	12.41	11.86	10.55	8.96	7.66	6.72	6.09	5.38	5.09	6.12 / 9.19	
GHLC-8	12.38	11.83	10.52	8.93	7.67	6.74	6.13	5.42	5.13	6.12 / 9.27	
GHLC-9	12.28	11.71	10.33	8.73	7.52	6.64	6.06	5.39	5.14	5.99 / 9.10	
GHLC-10	12.19	11.64	10.18	8.64	7.43	6.60	6.04	5.40	5.15	5.86 / 9.00	
GHLC-11	12.05	11.47	9.97	8.43	7.30	6.56	6.03	5.42	5.19	5.46 / 9.17	
GHLC-12	11.87	11.32	9.71	8.26	7.18	6.50	6.01	5.46	5.23	5.44 / 8.71	
GHLC-13	11.93	11.38	9.82	8.28	7.23	6.52	6.01	5.46	5.24	5.61 / 8.61	
GHLC-14	11.99	11.41	9.90	8.40	7.28	6.55	6.04	5.46	5.23	5.37 / 8.66	
GHLC-15	11.94	11.39	9.79	8.31	7.24	6.54	6.03	5.46	5.23	5.40 / 8.67	

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-16	11.99	11.40	9.82	8.28	7.26	6.55	6.06	5.49	5.26	5.49 / 8.61	
GHLC-17	11.96	11.44	9.76	8.30	7.28	6.57	6.08	5.51	5.28	5.53 / 8.62	
GHLC-18	11.97	11.39	9.72	8.32	7.27	6.57	6.08	5.51	5.29	5.38 / 8.54	
GHLC-19	11.89	11.31	9.64	8.27	7.23	6.54	6.05	5.51	5.28	5.35 / 8.51	
GHLC-20	11.98	11.36	9.68	8.28	7.33	6.62	6.12	5.57	5.34	5.29 / 8.66	
GHLC-21	12.00	11.41	9.65	8.29	7.37	6.65	6.17	5.63	5.39	5.43 / 8.71	
GHLC-22	12.16	11.57	9.79	8.39	7.41	6.68	6.18	5.63	5.39	5.56 / 8.90	
GHLC-23	12.25	11.61	9.81	8.45	7.46	6.72	6.21	5.65	5.41	5.58 / 8.96	
GHLC-24	12.20	11.54	9.76	8.43	7.46	6.75	6.23	5.68	5.44	5.46 / 8.99	
GHLC-25	12.04	11.40	9.59	8.26	7.39	6.74	6.20	5.68	5.44	5.44 / 9.01	
GHLC-26	11.82	11.18	9.42	8.14	7.27	6.62	6.14	5.63	5.41	5.28 / 8.66	
GHLC-27	11.10	10.49	8.92	7.85	7.12	6.52	6.08	5.64	5.42	5.10 / 8.80	
GHLC-28	11.74	11.09	9.27	8.06	7.26	6.60	6.14	5.64	5.42	5.35 / 8.81	
GHLC-29	11.02	10.39	8.81	7.84	7.10	6.48	6.07	5.63	5.42	5.13 / 8.77	
GHLC-30	10.85	10.26	8.75	7.77	7.06	6.45	6.04	5.61	5.40	5.04 / 8.81	
GHLC-31	10.68	10.05	8.60	7.67	6.98	6.40	6.01	5.59	5.39	4.92 / 8.62	
GHLC-32	10.50	9.88	8.50	7.56	6.92	6.37	6.00	5.61	5.41	4.87 / 8.51	
GHLC-33	10.86	10.23	8.70	7.78	7.03	6.44	6.04	5.62	5.41	5.04 / 8.65	
GHLC-34	10.60	9.93	8.49	7.58	6.93	6.36	6.00	5.61	5.41	4.97 / 8.44	
GHLC-35	10.70	10.04	8.58	7.63	6.96	6.38	6.02	5.62	5.40	5.03 / 8.44	
GHLC-36	11.17	10.47	8.88	7.92	7.12	6.49	6.07	5.64	5.42	5.10 / 8.64	
GHLC-37	11.06	10.38	8.81	7.83	7.06	6.44	6.05	5.62	5.40	5.04 / 8.55	
GHLC-38	11.43	10.73	9.06	8.02	7.20	6.56	6.11	5.65	5.43	5.24 / 8.69	
GHLC-39	11.30	10.55	8.90	7.93	7.13	6.49	6.07	5.63	5.41	5.20 / 8.54	
GHLC-40	11.83	11.10	9.29	8.14	7.32	6.64	6.15	5.67	5.43	5.54 / 8.83	
GHLC-41	11.34	10.64	9.00	7.94	7.17	6.55	6.10	5.65	5.43	5.27 / 8.59	
GHLC-42	11.81	11.03	9.27	8.16	7.30	6.63	6.14	5.66	5.43	5.48 / 8.77	
GHLC-43	12.25	11.43	9.60	8.36	7.47	6.75	6.22	5.70	5.46	5.85 / 8.95	
GHLC-44	12.94	12.10	10.11	8.78	7.76	6.94	6.36	5.77	5.50	6.19 / 9.25	
GHLC-45	12.70	11.88	9.87	8.58	7.61	6.85	6.28	5.73	5.47	6.04 / 9.04	
GHLC-46	12.84	11.97	9.97	8.62	7.66	6.89	6.32	5.74	5.48	6.06 / 9.06	
GHLC-47	12.92	12.01	10.01	8.67	7.67	6.92	6.34	5.77	5.49	6.07 / 8.96	
GHLC-48	12.19	11.35	9.48	8.26	7.37	6.72	6.20	5.70	5.45	5.55 / 8.60	
GHLC-49	12.23	11.40	9.48	8.23	7.36	6.72	6.19	5.69	5.45	5.58 / 8.53	
GHLC-50	12.90	12.02	10.00	8.67	7.65	6.90	6.33	5.75	5.48	6.03 / 8.94	
GHLC-51	12.49	11.61	9.65	8.39	7.45	6.77	6.23	5.71	5.46	5.79 / 8.57	
GHLC-52	12.12	11.29	9.33	8.17	7.32	6.66	6.16	5.68	5.44	5.56 / 8.40	
GHLC-53	12.39	11.53	9.58	8.30	7.42	6.75	6.22	5.71	5.47	5.79 / 8.56	
JHF-S1	12.15	11.55	10.32	8.95	7.75	6.80	6.16	5.40	5.08	6.00 / 9.24	
JHF-S2	12.09	11.53	10.23	8.94	7.73	6.78	6.14	5.39	5.08	5.98 / 9.07	
JHF-S3	12.09	11.56	10.30	8.93	7.73	6.78	6.15	5.40	5.09	6.02 / 8.96	
JHF-S4	12.01	11.43	10.01	8.66	7.52	6.67	6.09	5.42	5.16	5.74 / 8.83	
JHF-S5	11.86	11.27	9.84	8.46	7.34	6.57	6.05	5.42	5.18	5.56 / 8.65	
JHF-S6	11.90	11.38	9.91	8.51	7.40	6.61	6.06	5.44	5.19	5.60 / 8.61	
JHF-S7	11.86	11.30	9.86	8.47	7.37	6.59	6.06	5.44	5.19	5.56 / 8.56	
JHF-S8	11.48	10.96	9.39	7.99	7.08	6.44	5.99	5.48	5.26	5.30 / 8.13	
JHF-S9	11.53	10.97	9.42	8.05	7.09	6.45	6.00	5.49	5.27	5.29 / 8.13	
JHF-S10	11.43	10.84	9.15	7.89	7.11	6.51	6.07	5.60	5.39	5.21 / 8.24	
JHF-S11	11.87	11.28	9.47	8.18	7.30	6.64	6.17	5.66	5.43	5.53 / 8.72	
JHF-S12	12.04	11.39	9.54	8.24	7.39	6.70	6.21	5.70	5.46	5.66 / 8.81	
JHF-S13	7.66	7.39	6.74	5.99	5.35	4.84	4.46	3.97	3.73	2.84 / 8.23	
JHF-S14	7.63	7.44	6.68	6.01	5.36	4.84	4.46	3.98	3.74	2.83 / 8.09	
JHF-S15	7.63	7.45	6.71	6.01	5.38	4.86	4.48	3.98	3.75	2.83 / 8.03	
JHF-S16	8.09	7.90	7.12	6.35	5.69	5.12	4.70	4.14	3.91	3.16 / 8.09	
JHF-S17	8.10	7.89	7.10	6.36	5.66	5.09	4.68	4.12	3.90	3.13 / 7.95	

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-S18	8.11	7.87	7.14	6.38	5.67	5.10	4.68	4.12	3.89	3.12 /	7.87
GHLC-S1	11.95	11.32	10.14	8.86	7.74	6.79	6.05	5.22	4.86	6.45 /	9.92
GHLC-S2	11.84	11.24	10.08	8.86	7.70	6.75	6.03	5.21	4.85	6.42 /	9.97
GHLC-S3	11.92	11.27	10.13	8.90	7.72	6.76	6.05	5.22	4.87	6.48 /	9.91
GHLC-S4	12.05	11.40	10.22	8.94	7.76	6.78	6.10	5.31	4.97	6.32 /	9.85
GHLC-S5	11.97	11.42	10.21	8.88	7.74	6.76	6.09	5.29	4.96	6.25 /	9.75
GHLC-S6	12.14	11.57	10.33	9.06	7.83	6.84	6.17	5.37	5.03	6.19 /	9.52
GHLC-S7	12.11	11.54	10.35	9.03	7.82	6.83	6.15	5.37	5.03	6.19 /	9.51
GHLC-S8	12.15	11.57	10.30	9.00	7.83	6.84	6.16	5.37	5.03	6.19 /	9.48
GHLC-S9	12.13	11.55	10.30	9.01	7.81	6.82	6.14	5.36	5.02	6.20 /	9.47
GHLC-S10	12.10	11.52	10.28	9.00	7.81	6.82	6.15	5.36	5.02	6.17 /	9.41

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。