

P S J 予測統計値
(中央値)

2010年 7月 15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	13.23	13.05	10.88	9.70	9.03	7.92	7.39	7.09	6.78	6.73 / 10.93	
JHF-2	13.75	13.09	10.84	9.62	9.07	7.96	7.39	7.08	6.75	6.69 / 10.88	
JHF-3	13.81	13.12	10.87	9.91	9.10	7.97	7.44	7.08	6.76	6.78 / 11.07	
JHF-4	13.49	13.30	10.95	9.92	9.21	8.12	7.46	7.09	6.79	7.09 / 11.01	
JHF-5	14.06	13.75	11.33	9.85	9.22	8.16	7.49	7.18	6.82	7.39 / 11.40	
JHF-6	14.10	13.37	11.05	9.99	9.20	8.21	7.48	7.12	6.75	7.01 / 11.20	
JHF-7	13.87	12.52	10.42	9.48	8.78	7.96	7.44	7.03	6.69	6.29 / 10.72	
JHF-8	13.93	13.11	11.05	9.88	9.12	8.16	7.51	7.05	6.73	6.88 / 11.15	
JHF-9	13.70	12.74	10.46	9.53	8.75	7.94	7.49	7.06	6.65	6.27 / 10.81	
JHF-10	13.20	12.00	10.10	9.21	8.55	7.93	7.47	7.03	6.67	5.95 / 10.49	
JHF-11	13.78	12.77	10.42	9.54	8.69	8.07	7.51	7.02	6.68	6.29 / 10.95	
JHF-12	13.68	12.59	10.31	9.42	8.60	8.03	7.46	7.01	6.68	6.30 / 10.84	
JHF-13	13.59	12.47	10.27	9.42	8.58	7.95	7.48	6.99	6.67	6.24 / 10.91	
JHF-14	12.68	12.08	10.10	9.26	8.33	7.79	7.45	6.99	6.67	6.17 / 10.58	
JHF-15	13.89	13.16	10.78	9.84	8.88	8.14	7.60	7.02	6.76	7.14 / 11.60	
JHF-16	14.72	13.88	11.84	10.12	9.06	8.36	7.65	7.10	6.80	7.77 / 11.94	
JHF-17	14.13	13.47	11.07	9.87	9.00	8.23	7.66	7.15	6.78	7.24 / 11.74	
JHF-18	14.02	13.14	10.78	9.73	8.76	8.09	7.60	7.10	6.73	7.04 / 11.43	
JHF-19	13.47	12.48	10.46	9.36	8.66	7.87	7.53	7.10	6.68	6.49 / 10.70	
JHF-20	13.65	12.61	10.59	9.41	8.67	7.90	7.57	7.11	6.70	6.63 / 10.85	
JHF-21	13.83	13.10	10.81	9.55	8.78	7.99	7.57	7.14	6.72	6.85 / 11.22	
JHF-22	13.80	13.16	10.82	9.53	8.75	7.99	7.52	7.14	6.72	6.94 / 11.34	
JHF-23	14.49	13.88	11.08	9.82	8.92	8.10	7.61	7.13	6.78	7.48 / 11.83	
JHF-24	14.05	13.55	10.99	9.66	8.84	8.06	7.56	7.17	6.76	7.10 / 11.71	
JHF-25	14.15	13.62	10.85	9.66	8.79	8.05	7.58	7.20	6.76	7.07 / 11.61	
JHF-26	14.54	13.90	10.92	9.84	8.83	8.14	7.60	7.24	6.78	7.54 / 11.65	
JHF-27	14.08	13.84	10.82	9.70	8.72	8.08	7.63	7.23	6.79	6.99 / 11.46	
JHF-28	13.26	13.24	10.34	9.35	8.48	7.94	7.63	7.08	6.76	6.51 / 10.88	
JHF-29	13.13	12.98	10.23	9.26	8.45	7.93	7.64	7.06	6.80	6.43 / 10.69	
JHF-30	12.76	12.49	9.91	9.07	8.40	7.89	7.63	7.03	6.79	6.38 / 10.44	
JHF-31	12.68	12.17	9.67	9.01	8.30	7.86	7.58	7.01	6.81	6.30 / 10.25	
JHF-32	12.98	12.59	9.90	9.11	8.42	7.93	7.68	7.08	6.86	6.32 / 10.61	
JHF-33	12.65	12.06	9.64	9.02	8.29	7.87	7.58	7.06	6.87	6.23 / 10.32	
JHF-34	12.74	12.13	9.70	9.07	8.35	7.92	7.62	7.11	6.91	6.25 / 10.54	
JHF-35	10.73	10.34	9.06	8.43	7.88	7.76	7.32	7.04	6.87	5.84 / 9.66	
JHF-36	10.44	10.17	8.80	8.31	7.88	7.75	7.30	7.05	6.88	5.78 / 9.58	
JHF-37	10.44	10.15	8.84	8.29	7.92	7.76	7.34	7.08	6.92	5.78 / 9.64	
JHF-38	10.32	9.92	8.87	8.22	7.90	7.75	7.34	7.10	6.95	5.66 / 9.62	
GHLC-1	12.50	12.50	11.68	10.27	8.22	6.81	6.49	5.61	4.98	5.27 / 10.53	
GHLC-2	12.54	12.54	11.72	10.25	8.13	6.81	6.56	5.58	5.02	5.53 / 10.34	
GHLC-3	12.65	12.65	11.76	10.14	8.10	6.89	6.61	5.45	5.01	5.75 / 10.08	
GHLC-4	12.50	12.50	11.51	9.79	8.40	6.76	6.51	5.53	4.98	6.06 / 10.29	
GHLC-5	12.60	12.60	11.60	9.71	8.30	6.79	6.56	5.57	5.07	6.02 / 10.30	
GHLC-6	12.78	12.78	11.39	9.75	8.35	6.97	6.61	5.60	5.13	6.31 / 10.07	
GHLC-7	12.85	12.85	11.47	9.75	8.37	7.16	6.64	5.59	5.13	6.24 / 9.69	
GHLC-8	12.95	12.95	11.45	9.68	8.39	7.13	6.67	5.60	5.14	6.40 / 9.78	
GHLC-9	12.96	12.96	11.32	9.52	8.05	6.96	6.56	5.64	5.17	6.37 / 9.52	
GHLC-10	12.78	12.78	10.91	9.32	7.99	6.93	6.48	5.60	5.19	6.43 / 9.48	
GHLC-11	12.40	12.40	10.41	9.09	7.88	6.91	6.35	5.53	5.32	6.08 / 9.62	
GHLC-12	12.21	12.21	9.94	8.81	7.90	6.93	6.30	5.51	5.39	5.92 / 9.09	
GHLC-13	12.30	12.30	10.14	8.92	7.88	7.00	6.35	5.54	5.37	5.89 / 9.45	

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	12.40	12.40	10.31	8.98	7.90	6.96	6.37	5.56	5.38	5.82 /	9.14
GHLC-15	12.27	12.27	10.10	8.89	7.82	6.94	6.35	5.54	5.46	5.87 /	9.14
GHLC-16	12.20	12.20	9.98	8.86	7.84	6.95	6.31	5.53	5.43	5.91 /	9.14
GHLC-17	12.19	12.19	10.08	8.86	7.90	6.98	6.35	5.56	5.48	5.97 /	9.10
GHLC-18	12.16	12.16	10.01	8.85	7.85	6.99	6.32	5.63	5.48	5.97 /	8.92
GHLC-19	12.04	12.04	9.79	8.77	7.77	6.92	6.28	5.61	5.44	5.91 /	8.87
GHLC-20	11.97	11.97	9.72	8.76	7.81	6.98	6.34	5.72	5.44	5.65 /	9.02
GHLC-21	11.96	11.96	9.72	8.76	7.79	7.10	6.37	5.78	5.48	5.80 /	9.03
GHLC-22	12.17	12.17	10.04	8.92	7.87	7.12	6.36	5.74	5.56	5.94 /	9.28
GHLC-23	12.17	12.17	9.93	8.91	7.80	7.14	6.39	5.81	5.54	5.94 /	9.27
GHLC-24	12.14	12.14	9.89	8.76	7.80	7.18	6.43	5.87	5.57	5.86 /	9.38
GHLC-25	11.93	11.93	9.73	8.27	7.71	7.20	6.46	5.91	5.54	5.84 /	9.37
GHLC-26	11.63	11.63	9.44	8.57	7.72	7.06	6.37	5.84	5.42	5.58 /	8.93
GHLC-27	10.59	10.59	9.11	7.94	7.47	6.91	6.44	5.89	5.51	5.31 /	9.10
GHLC-28	11.48	11.48	9.41	7.98	7.55	7.05	6.36	5.92	5.49	5.59 /	9.12
GHLC-29	10.48	10.48	9.06	7.95	7.43	6.86	6.40	5.90	5.54	5.32 /	9.11
GHLC-30	10.30	10.30	8.60	8.00	7.44	6.81	6.35	5.89	5.55	5.40 /	9.14
GHLC-31	10.05	10.05	8.59	7.88	7.42	6.69	6.38	5.81	5.49	5.24 /	8.95
GHLC-32	9.85	9.70	8.40	7.81	7.31	6.68	6.29	5.76	5.50	5.04 /	8.84
GHLC-33	10.31	10.31	8.81	7.91	7.45	6.71	6.40	5.85	5.47	5.23 /	9.00
GHLC-34	10.27	10.05	8.34	7.76	7.28	6.62	6.29	5.73	5.52	5.13 /	8.77
GHLC-35	10.38	10.29	8.45	7.82	7.37	6.66	6.32	5.74	5.46	5.21 /	8.79
GHLC-36	11.09	10.74	8.98	7.98	7.51	6.89	6.43	5.89	5.56	5.42 /	9.01
GHLC-37	10.98	10.57	8.77	7.93	7.51	6.83	6.44	5.86	5.53	5.34 /	8.93
GHLC-38	11.60	10.86	9.11	8.08	7.58	7.01	6.53	5.90	5.50	5.48 /	9.09
GHLC-39	11.37	10.71	8.93	8.02	7.55	6.93	6.45	5.84	5.52	5.42 /	8.97
GHLC-40	11.80	11.36	9.34	8.21	7.67	7.13	6.44	5.95	5.53	5.85 /	9.27
GHLC-41	11.41	10.83	9.04	8.05	7.59	6.97	6.46	5.80	5.55	5.52 /	9.02
GHLC-42	11.94	11.05	9.32	8.26	7.71	7.12	6.39	5.89	5.61	5.95 /	9.25
GHLC-43	12.18	11.60	9.72	8.45	7.86	7.26	6.54	5.99	5.61	6.26 /	9.45
GHLC-44	13.02	12.37	10.54	8.74	8.06	7.35	6.62	6.08	5.65	6.56 /	9.78
GHLC-45	12.83	12.07	10.12	8.60	7.97	7.38	6.56	6.04	5.59	6.38 /	9.57
GHLC-46	12.74	12.14	10.25	8.64	8.01	7.39	6.66	6.04	5.64	6.43 /	9.56
GHLC-47	12.34	12.15	10.23	8.67	8.03	7.42	6.66	6.05	5.60	6.41 /	9.54
GHLC-48	12.79	11.50	9.35	8.36	7.77	7.10	6.52	5.83	5.60	5.91 /	9.09
GHLC-49	12.07	11.52	9.32	8.36	7.78	7.11	6.57	5.82	5.58	6.02 /	9.04
GHLC-50	13.14	12.13	10.13	8.68	7.97	7.45	6.71	6.00	5.63	6.36 /	9.59
GHLC-51	12.30	11.67	9.53	8.48	7.80	7.22	6.57	5.84	5.57	6.12 /	9.17
GHLC-52	12.22	11.20	9.21	8.30	7.86	7.01	6.43	5.76	5.57	5.91 /	8.93
GHLC-53	12.44	11.55	9.44	8.42	7.84	7.12	6.52	5.81	5.63	6.07 /	9.19
JHF-S1	12.23	12.23	10.71	9.52	8.23	6.91	6.48	5.62	5.34	6.64 /	9.72
JHF-S2	12.18	12.18	10.51	9.50	8.12	6.98	6.48	5.62	5.35	6.63 /	9.54
JHF-S3	12.26	12.26	10.58	9.44	8.09	7.05	6.49	5.61	5.39	6.65 /	9.55
JHF-S4	12.12	12.12	10.18	8.99	7.98	6.84	6.44	5.63	5.46	6.30 /	9.31
JHF-S5	11.99	11.99	9.82	8.78	7.89	6.76	6.30	5.68	5.39	6.04 /	9.06
JHF-S6	12.04	12.04	9.93	8.87	7.93	6.77	6.34	5.69	5.40	6.08 /	9.07
JHF-S7	12.09	12.09	9.85	8.89	7.93	6.77	6.33	5.67	5.39	6.06 /	9.01
JHF-S8	11.66	11.43	9.18	8.46	7.67	6.77	6.17	5.83	5.33	5.66 /	8.51
JHF-S9	11.69	11.43	9.15	8.41	7.68	6.75	6.17	5.85	5.33	5.67 /	8.53
JHF-S10	11.10	10.99	8.93	8.25	7.53	6.93	6.21	5.85	5.39	5.51 /	8.67
JHF-S11	11.59	11.59	9.32	8.43	7.71	7.15	6.28	6.01	5.53	5.85 /	9.24
JHF-S12	11.82	11.14	9.43	8.50	7.81	7.18	6.48	6.02	5.60	5.99 /	9.33
JHF-S13	7.56	7.56	7.54	7.15	6.36	5.37	4.87	4.49	3.78	2.82 /	8.76
JHF-S14	7.63	7.63	7.56	7.16	6.39	5.38	4.90	4.47	3.78	2.81 /	8.57
JHF-S15	7.67	7.67	7.60	7.15	6.45	5.41	4.88	4.48	3.79	2.80 /	8.51

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	8.06	8.06	7.85	7.27	6.61	5.68	5.09	4.58	3.91	3.14 /	8.54
JHF-S17	8.05	8.05	7.84	7.25	6.58	5.67	5.05	4.55	3.95	3.10 /	8.42
JHF-S18	8.07	8.07	7.85	7.29	6.62	5.68	5.06	4.46	3.94	3.10 /	8.32
GHLC-S1	11.81	11.81	10.77	9.24	7.73	6.67	6.35	5.52	5.12	6.67 /	10.41
GHLC-S2	11.68	11.68	10.76	9.16	7.61	6.73	6.35	5.56	5.14	6.73 /	10.48
GHLC-S3	11.87	11.87	10.90	9.25	7.67	6.69	6.38	5.50	5.14	6.72 /	10.45
GHLC-S4	11.83	11.83	10.82	9.20	7.87	6.67	6.44	5.60	5.16	6.83 /	10.43
GHLC-S5	11.82	11.82	10.77	9.21	7.82	6.65	6.39	5.59	5.14	6.87 /	10.34
GHLC-S6	12.14	12.14	10.73	9.44	8.07	6.85	6.43	5.69	5.16	6.89 /	10.00
GHLC-S7	12.07	12.07	10.75	9.41	8.07	6.86	6.44	5.63	5.18	6.88 /	9.99
GHLC-S8	12.05	12.05	10.68	9.40	8.11	6.91	6.44	5.64	5.19	6.86 /	10.01
GHLC-S9	12.05	12.05	10.69	9.44	8.13	6.87	6.43	5.59	5.19	6.87 /	9.97
GHLC-S10	12.09	12.09	10.64	9.42	8.08	6.94	6.41	5.62	5.22	6.83 /	9.90

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。