

P S J 予測統計値
(中央値)

2010年 8月 16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、バークレイズ・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	13.95	12.95	11.55	9.89	9.29	8.13	7.48	7.17	6.82	7.12 / 11.44	
JHF-2	14.03	12.76	11.49	10.11	9.31	8.22	7.46	7.17	6.80	7.08 / 11.42	
JHF-3	14.30	13.16	11.54	10.03	9.34	8.18	7.51	7.22	6.83	7.34 / 11.59	
JHF-4	13.74	13.41	11.75	10.24	9.43	8.28	7.49	7.20	6.85	7.59 / 11.55	
JHF-5	14.07	13.44	12.10	10.28	9.47	8.43	7.59	7.20	6.95	7.92 / 11.95	
JHF-6	13.95	13.58	11.87	10.05	9.48	8.36	7.61	7.19	6.87	7.50 / 11.75	
JHF-7	13.79	12.56	11.24	9.73	9.11	8.19	7.60	7.22	6.75	6.60 / 11.24	
JHF-8	14.50	12.94	11.89	10.16	9.39	8.40	7.70	7.22	6.85	7.35 / 11.71	
JHF-9	13.76	12.77	11.39	9.75	9.13	8.20	7.60	7.26	6.77	6.71 / 11.31	
JHF-10	13.13	12.03	10.72	9.45	8.81	8.19	7.55	7.08	6.70	6.23 / 11.01	
JHF-11	13.66	12.76	11.36	9.75	9.03	8.29	7.57	7.22	6.79	6.62 / 11.49	
JHF-12	13.90	12.62	11.20	9.65	8.94	8.25	7.55	7.17	6.74	6.62 / 11.35	
JHF-13	13.84	12.47	11.09	9.67	8.84	8.24	7.57	7.12	6.75	6.52 / 11.45	
JHF-14	12.60	12.07	10.73	9.51	8.64	8.15	7.56	7.00	6.69	6.44 / 11.09	
JHF-15	14.20	13.79	11.98	10.16	9.27	8.40	7.68	7.35	6.85	7.78 / 12.15	
JHF-16	14.33	13.77	12.54	10.47	9.46	8.62	7.73	7.32	6.93	8.17 / 12.54	
JHF-17	14.17	13.83	12.27	10.19	9.23	8.57	7.84	7.33	6.90	7.77 / 12.32	
JHF-18	14.05	13.66	11.99	10.05	9.02	8.45	7.77	7.23	6.85	7.54 / 12.00	
JHF-19	13.47	12.78	11.17	9.66	8.70	8.13	7.59	7.10	6.73	6.81 / 11.21	
JHF-20	13.52	12.96	11.32	9.71	8.82	8.15	7.63	7.13	6.77	7.00 / 11.37	
JHF-21	13.86	13.25	11.72	9.84	8.96	8.25	7.67	7.17	6.81	7.29 / 11.77	
JHF-22	13.78	13.34	11.71	9.86	8.96	8.23	7.66	7.14	6.80	7.40 / 11.88	
JHF-23	14.46	14.06	12.45	10.14	9.18	8.38	7.79	7.22	6.87	8.05 / 12.40	
JHF-24	14.05	13.65	12.07	9.95	9.09	8.31	7.72	7.16	6.85	7.54 / 12.27	
JHF-25	14.10	13.71	12.08	9.95	8.96	8.28	7.71	7.20	6.83	7.54 / 12.15	
JHF-26	14.25	14.20	12.61	10.15	9.00	8.37	7.78	7.15	6.87	8.15 / 12.24	
JHF-27	13.86	13.81	12.08	10.00	8.91	8.23	7.73	7.25	6.85	7.45 / 12.01	
JHF-28	13.23	13.23	11.00	9.58	8.73	8.01	7.64	7.22	6.80	6.83 / 11.39	
JHF-29	13.10	12.98	10.70	9.51	8.66	7.96	7.64	7.19	6.80	6.70 / 11.16	
JHF-30	12.69	12.45	10.39	9.36	8.53	7.94	7.65	7.16	6.82	6.64 / 10.90	
JHF-31	12.62	12.14	10.27	9.25	8.47	7.99	7.64	7.12	6.83	6.55 / 10.72	
JHF-32	12.93	12.59	10.63	9.40	8.59	8.03	7.71	7.22	6.88	6.64 / 11.08	
JHF-33	12.56	12.04	10.26	9.22	8.51	8.04	7.67	7.15	6.88	6.50 / 10.78	
JHF-34	12.64	12.10	10.32	9.24	8.57	8.11	7.72	7.19	6.92	6.49 / 10.97	
JHF-35	10.75	10.35	9.05	8.50	8.05	7.75	7.37	7.06	6.88	6.09 / 9.70	
JHF-36	10.49	10.25	9.06	8.41	7.96	7.74	7.36	7.07	6.89	6.05 / 9.60	
JHF-37	10.50	10.19	9.10	8.45	7.98	7.76	7.40	7.10	6.92	6.04 / 9.67	
JHF-38	10.26	9.97	8.94	8.32	7.93	7.74	7.38	7.11	6.94	5.95 / 9.66	
JHF-39	9.93	9.74	8.79	8.31	7.88	7.76	7.38	7.13	6.97	5.79 / 9.60	
GHLC-1	12.52	12.52	12.31	10.62	8.97	7.01	6.51	5.77	5.02	5.14 / 11.11	
GHLC-2	12.56	12.56	12.40	10.62	8.70	7.07	6.57	5.74	5.05	5.44 / 10.83	
GHLC-3	12.71	12.71	12.40	10.54	8.52	7.14	6.61	5.65	5.04	5.66 / 10.56	
GHLC-4	12.46	12.46	12.07	10.35	9.10	7.25	6.52	5.65	5.06	6.01 / 10.78	
GHLC-5	12.55	12.55	12.07	10.30	8.62	7.28	6.56	5.76	5.10	5.95 / 10.79	
GHLC-6	12.72	12.72	11.96	10.17	8.80	7.39	6.61	5.69	5.16	6.25 / 10.52	
GHLC-7	12.80	12.80	12.10	10.26	9.03	7.53	6.65	5.70	5.16	6.18 / 10.13	
GHLC-8	12.85	12.85	12.03	10.08	8.99	7.52	6.69	5.68	5.16	6.36 / 10.22	
GHLC-9	12.98	12.98	11.93	9.85	8.77	7.32	6.73	5.74	5.17	6.36 / 10.06	
GHLC-10	12.78	12.78	11.61	9.65	8.66	7.24	6.65	5.69	5.19	6.48 / 9.82	
GHLC-11	12.42	12.42	11.09	9.34	8.28	7.09	6.51	5.61	5.31	6.56 / 10.04	
GHLC-12	12.21	12.21	10.65	9.10	8.02	7.14	6.42	5.59	5.37	6.27 / 9.50	

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-13	12.28	12.28	10.88	9.26	8.00	7.20	6.49	5.64	5.35	6.10 / 9.94	
GHLC-14	12.38	12.38	11.03	9.28	8.10	7.25	6.53	5.62	5.36	6.40 / 9.71	
GHLC-15	12.26	12.26	10.82	9.18	7.95	7.19	6.48	5.60	5.44	6.31 / 9.63	
GHLC-16	12.20	12.20	10.67	9.15	7.96	7.15	6.46	5.57	5.45	6.21 / 9.66	
GHLC-17	12.21	12.21	10.77	9.14	8.02	7.17	6.47	5.61	5.43	6.08 / 9.63	
GHLC-18	12.09	12.09	10.71	9.12	7.98	7.12	6.47	5.61	5.51	6.41 / 9.43	
GHLC-19	12.03	12.03	10.54	9.03	7.89	7.09	6.42	5.61	5.53	6.33 / 9.31	
GHLC-20	11.97	11.97	10.42	9.00	7.94	7.08	6.45	5.79	5.56	6.13 / 9.44	
GHLC-21	11.94	11.94	10.40	9.02	7.93	7.13	6.48	5.79	5.60	6.19 / 9.45	
GHLC-22	12.14	12.14	10.76	9.20	8.00	7.19	6.50	5.75	5.60	6.31 / 9.77	
GHLC-23	12.14	12.14	10.70	9.18	7.92	7.18	6.50	5.80	5.63	6.30 / 9.73	
GHLC-24	12.06	12.06	10.61	9.16	7.93	7.21	6.55	5.87	5.66	6.18 / 9.75	
GHLC-25	11.85	11.85	10.33	9.06	7.85	7.23	6.59	6.00	5.63	6.14 / 9.69	
GHLC-26	11.60	11.60	9.90	8.81	7.87	7.16	6.57	5.84	5.51	6.02 / 9.21	
GHLC-27	10.53	10.53	9.37	8.05	7.56	7.10	6.48	6.00	5.53	5.50 / 9.34	
GHLC-28	11.44	11.44	9.79	8.77	7.70	7.27	6.54	5.92	5.51	5.84 / 9.43	
GHLC-29	10.43	10.43	9.32	8.05	7.61	7.12	6.44	5.99	5.57	5.48 / 9.34	
GHLC-30	10.24	10.24	9.30	8.09	7.65	7.14	6.40	6.01	5.61	5.58 / 9.41	
GHLC-31	10.00	10.00	9.07	7.97	7.48	6.94	6.49	5.86	5.52	5.39 / 9.18	
GHLC-32	9.65	9.65	8.89	7.88	7.43	6.80	6.53	5.88	5.54	5.30 / 9.06	
GHLC-33	10.27	10.27	9.13	8.01	7.54	6.92	6.54	5.92	5.56	5.40 / 9.23	
GHLC-34	10.03	10.03	8.86	7.85	7.48	6.82	6.48	5.88	5.54	5.29 / 9.00	
GHLC-35	10.28	10.28	8.90	7.90	7.49	6.88	6.50	5.87	5.53	5.36 / 9.01	
GHLC-36	10.73	10.73	9.26	8.12	7.61	7.10	6.47	5.96	5.59	5.63 / 9.28	
GHLC-37	10.58	10.58	9.14	8.08	7.61	7.07	6.50	5.91	5.57	5.54 / 9.18	
GHLC-38	10.86	10.86	9.39	8.21	7.70	7.23	6.57	5.96	5.60	5.85 / 9.39	
GHLC-39	10.72	10.67	9.22	8.10	7.66	7.11	6.56	5.94	5.57	5.66 / 9.20	
GHLC-40	11.37	11.37	9.76	8.37	7.80	7.33	6.57	6.02	5.62	6.16 / 9.57	
GHLC-41	10.80	10.80	9.29	8.16	7.70	7.14	6.59	5.97	5.61	5.76 / 9.29	
GHLC-42	11.17	11.15	9.84	8.39	7.86	7.33	6.51	6.04	5.64	6.29 / 9.57	
GHLC-43	11.63	11.63	10.39	8.59	7.99	7.48	6.69	6.12	5.67	6.63 / 9.80	
GHLC-44	12.61	12.37	11.26	9.14	8.21	7.57	6.73	6.19	5.72	7.02 / 10.15	
GHLC-45	12.29	12.01	10.87	8.77	8.10	7.58	6.83	6.17	5.67	6.81 / 9.93	
GHLC-46	12.60	12.29	10.86	8.86	8.14	7.59	7.00	6.16	5.70	6.87 / 10.07	
GHLC-47	12.78	12.35	10.96	8.84	8.14	7.62	6.99	6.17	5.70	6.86 / 10.04	
GHLC-48	12.11	11.49	9.98	8.49	7.91	7.32	6.69	6.01	5.62	6.27 / 9.54	
GHLC-49	12.21	11.49	9.95	8.51	7.90	7.35	6.74	6.03	5.63	6.38 / 9.56	
GHLC-50	13.04	12.10	10.92	8.85	8.20	7.63	6.99	6.14	5.69	6.81 / 10.16	
GHLC-51	12.53	11.70	10.24	8.63	7.97	7.47	6.77	6.03	5.65	6.51 / 9.72	
GHLC-52	12.08	11.34	9.83	8.55	7.82	7.24	6.65	6.03	5.61	6.27 / 9.44	
GHLC-53	12.41	11.56	10.13	8.67	7.93	7.35	6.76	6.08	5.66	6.44 / 9.72	
JHF-S1	12.24	12.24	11.07	10.09	8.63	7.31	6.47	5.71	5.31	7.12 / 10.17	
JHF-S2	12.18	12.18	11.03	10.04	8.59	7.21	6.48	5.72	5.33	7.12 / 9.96	
JHF-S3	12.27	12.27	11.05	9.87	8.60	7.17	6.49	5.71	5.36	7.15 / 10.02	
JHF-S4	12.11	12.11	10.75	9.19	8.37	7.09	6.57	5.71	5.50	6.85 / 9.77	
JHF-S5	12.00	12.00	10.39	9.00	8.21	7.01	6.46	5.68	5.51	6.54 / 9.53	
JHF-S6	12.02	12.02	10.49	9.04	8.25	7.02	6.48	5.67	5.52	6.62 / 9.55	
JHF-S7	12.02	12.02	10.41	9.04	8.24	7.05	6.48	5.66	5.50	6.56 / 9.48	
JHF-S8	11.65	11.65	9.58	8.65	7.87	6.89	6.29	5.82	5.42	6.06 / 8.92	
JHF-S9	11.66	11.66	9.62	8.61	7.88	6.90	6.30	5.84	5.43	6.08 / 8.99	
JHF-S10	11.12	11.12	9.17	8.40	7.66	7.13	6.34	5.97	5.42	5.86 / 8.77	
JHF-S11	11.60	11.60	9.74	8.75	7.98	7.41	6.45	6.09	5.57	6.24 / 9.45	
JHF-S12	11.79	11.50	10.00	8.85	7.98	7.32	6.69	6.14	5.59	6.39 / 9.59	
JHF-S13	7.55	7.55	7.53	7.07	6.42	5.40	4.94	4.56	3.78	2.85 / 9.04	
JHF-S14	7.57	7.57	7.55	7.14	6.38	5.41	4.90	4.51	3.81	2.84 / 8.89	

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-S15	7.61	7.61	7.59	7.15	6.42	5.49	4.95	4.53	3.83	2.82 /	8.84
JHF-S16	8.00	8.00	7.92	7.27	6.69	5.78	5.12	4.66	3.99	3.18 /	8.89
JHF-S17	8.00	8.00	7.87	7.28	6.72	5.71	5.05	4.65	4.00	3.13 /	8.72
JHF-S18	8.00	8.00	7.91	7.30	6.73	5.74	5.12	4.67	3.99	3.12 /	8.63
GHLC-S1	11.81	11.81	11.34	9.73	8.16	6.88	6.37	5.69	5.16	6.63 /	10.87
GHLC-S2	11.68	11.68	11.18	9.70	7.97	6.72	6.36	5.61	5.16	6.70 /	10.93
GHLC-S3	11.86	11.86	11.36	9.67	8.26	6.93	6.38	5.60	5.18	6.67 /	10.92
GHLC-S4	11.79	11.79	11.29	9.71	8.42	6.94	6.44	5.73	5.19	6.77 /	10.91
GHLC-S5	11.80	11.80	11.18	9.70	8.32	6.86	6.41	5.72	5.20	6.84 /	10.82
GHLC-S6	12.13	12.13	11.28	9.97	8.69	7.59	6.44	5.72	5.20	6.97 /	10.48
GHLC-S7	12.07	12.07	11.24	9.93	8.68	7.33	6.44	5.71	5.21	7.00 /	10.46
GHLC-S8	12.06	12.06	11.17	9.93	8.68	7.48	6.44	5.75	5.18	7.04 /	10.41
GHLC-S9	12.10	12.10	11.17	9.97	8.68	7.41	6.44	5.74	5.21	7.05 /	10.43
GHLC-S10	12.07	12.07	11.12	9.93	8.68	7.41	6.40	5.74	5.18	7.09 /	10.36

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。