

P S J 予測統計値
(中央値)

2009年 6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、野村、三菱UFJ、ゴールドマン・サックス、エイガン・スタンレー、クレディ・スイス、ドイツ、JPモルガン、UBS、メリル・リンチ日本、大和SMBC、新生、日興フィグループ												
回号	Yield Curve Scenarios (%)										最低 / 最高(%)	
	-300bp	-200bp	-100bp	-50bp	0bp	50bp	100bp	200bp	300bp			
JHF-1	12.93	12.42	9.70	8.68	8.60	7.86	7.35	6.92	6.66	7.13 / 11.68		
JHF-2	12.84	12.38	9.74	8.69	8.58	7.86	7.37	6.93	6.67	7.12 / 11.61		
JHF-3	13.06	12.74	9.89	8.76	8.60	7.89	7.37	6.94	6.69	7.15 / 11.87		
JHF-4	13.37	12.98	9.94	8.78	8.67	7.92	7.44	6.96	6.71	7.17 / 11.83		
JHF-5	13.98	13.24	10.19	9.03	8.76	8.00	7.44	6.99	6.71	7.22 / 12.21		
JHF-6	13.61	12.96	10.05	8.90	8.71	7.95	7.39	6.97	6.70	7.18 / 11.99		
JHF-7	12.56	12.12	9.63	8.80	8.38	7.75	7.37	6.91	6.72	7.08 / 11.45		
JHF-8	13.45	12.89	10.10	8.94	8.62	7.91	7.43	6.97	6.72	7.17 / 11.97		
JHF-9	12.83	12.44	9.86	8.83	8.14	7.64	7.26	6.88	6.72	7.10 / 11.58		
JHF-10	12.29	11.57	9.57	8.83	8.24	7.70	7.33	6.92	6.73	7.05 / 11.30		
JHF-11	12.83	12.43	9.95	8.84	8.39	7.79	7.41	6.97	6.78	7.13 / 11.85		
JHF-12	12.73	12.27	9.85	8.86	8.38	7.78	7.42	6.99	6.79	7.13 / 11.75		
JHF-13	12.53	12.09	9.91	8.86	8.29	7.73	7.37	6.98	6.79	7.14 / 11.89		
JHF-14	12.32	11.68	9.74	8.89	8.23	7.70	7.37	6.99	6.79	7.11 / 11.51		
JHF-15	13.88	13.56	10.49	9.29	8.59	7.95	7.49	7.07	6.85	7.30 / 12.66		
JHF-16	14.56	14.08	11.25	9.94	8.78	8.07	7.60	7.11	6.86	7.39 / 13.09		
JHF-17	14.11	13.75	10.79	9.55	8.69	8.06	7.60	7.12	6.89	7.33 / 12.91		
JHF-18	13.92	13.32	10.54	9.32	8.59	8.04	7.57	7.12	6.88	7.30 / 12.55		
JHF-19	13.04	12.42	10.19	9.01	8.34	7.84	7.49	7.09	6.88	7.22 / 11.73		
JHF-20	13.23	12.69	10.36	9.13	8.39	7.90	7.53	7.12	6.93	7.25 / 11.96		
JHF-21	13.76	13.07	10.59	9.32	8.56	7.97	7.62	7.20	6.97	7.29 / 12.42		
JHF-22	13.89	13.41	10.59	9.32	8.57	8.01	7.59	7.23	6.99	7.31 / 12.57		
JHF-23	14.76	14.32	10.93	9.61	8.61	8.15	7.55	7.27	7.05	7.40 / 13.15		
JHF-24	14.36	13.97	10.81	9.52	8.72	8.11	7.57	7.28	7.07	7.37 / 13.02		
JHF-25	14.47	14.06	10.63	9.36	8.67	8.08	7.66	7.26	7.05	7.38 / 12.80		
GHLC-1	12.75	12.75	10.77	8.34	7.17	6.00	5.18	4.89	4.56	5.22 / 10.18		
GHLC-2	13.02	12.87	10.91	8.28	7.31	6.08	5.24	4.95	4.62	5.22 / 10.10		
GHLC-3	13.11	12.94	10.99	8.27	7.36	6.18	5.21	5.02	4.61	5.20 / 10.07		
GHLC-4	13.06	12.77	10.82	7.93	7.09	6.09	5.47	5.10	4.53	5.02 / 10.07		
GHLC-5	13.06	12.77	10.84	7.90	7.11	6.13	5.56	5.14	4.60	5.05 / 10.09		
GHLC-6	13.40	12.99	11.40	7.94	7.15	6.49	5.99	5.16	4.89	5.08 / 9.99		
GHLC-7	13.51	12.97	11.32	7.92	7.09	6.47	5.94	5.14	5.02	5.12 / 9.99		
GHLC-8	13.34	12.93	11.23	7.97	7.15	6.53	6.00	5.20	5.13	5.14 / 10.01		
GHLC-9	13.26	12.52	10.78	7.88	7.09	6.47	5.94	5.22	5.14	5.13 / 9.79		
GHLC-10	13.13	12.64	10.54	7.77	7.04	6.41	5.88	5.28	5.20	5.10 / 9.65		
GHLC-11	12.63	12.43	9.96	7.64	6.93	6.33	5.85	5.32	5.23	5.08 / 9.40		
GHLC-12	12.19	12.10	9.46	7.50	6.81	6.24	5.78	5.43	5.39	5.06 / 9.21		
GHLC-13	12.34	11.95	9.70	7.59	6.87	6.29	5.81	5.43	5.42	5.11 / 9.29		
GHLC-14	12.36	12.35	9.79	7.65	6.91	6.31	5.87	5.43	5.33	5.10 / 9.37		
GHLC-15	12.44	11.79	9.62	7.57	6.86	6.28	5.84	5.45	5.36	5.09 / 9.28		
GHLC-16	12.41	12.24	9.61	7.54	6.84	6.27	5.83	5.44	5.41	5.08 / 9.23		
GHLC-17	12.37	11.75	9.53	7.59	6.86	6.29	5.83	5.48	5.41	5.15 / 9.26		
GHLC-18	12.17	12.08	9.30	7.56	6.86	6.29	5.84	5.52	5.42	5.15 / 9.19		
GHLC-19	12.17	11.39	9.32	7.51	6.81	6.24	5.97	5.53	5.38	5.15 / 9.11		
GHLC-20	12.09	12.06	9.21	7.51	7.18	6.43	6.23	5.61	5.43	5.19 / 9.09		
GHLC-21	12.09	11.85	9.08	7.50	7.08	6.42	6.22	5.67	5.43	5.25 / 9.06		
GHLC-22	12.25	11.30	9.24	7.62	6.91	6.33	6.05	5.64	5.46	5.34 / 9.20		
GHLC-23	12.41	11.95	9.17	7.64	7.13	6.45	6.16	5.70	5.46	5.36 / 9.24		
GHLC-24	11.96	11.27	9.05	7.60	7.40	6.52	6.14	5.72	5.43	5.41 / 9.26		
GHLC-25	12.15	11.13	8.64	7.51	7.47	7.12	6.16	5.77	5.38	5.43 / 9.07		
GHLC-26	11.68	11.21	8.55	7.46	7.46	6.58	6.02	5.71	5.36	5.23 / 8.80		

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、野村、三菱UFJ、コールドマン・サクス、カギン・スタンレー、クレディ・スイス、ドイツ、JPモルガン、UBS、メリル・リンチ日本、大和SMBC、新生、日興フィグループ

回号	Yield Curve Scenarios (%)									最低 / 最高(%)	
	-300bp	-200bp	-100bp	-50bp	0bp	50bp	100bp	200bp	300bp		
GHLC-27	10.95	10.21	8.03	7.62	7.58	6.70	5.93	5.69	5.41	5.34 /	8.44
GHLC-28	11.66	10.60	8.21	7.54	7.54	6.66	6.08	5.77	5.32	5.32 /	8.69
GHLC-29	10.69	10.13	7.90	7.64	7.43	6.66	6.00	5.67	5.43	5.37 /	8.54
GHLC-30	10.27	10.05	7.83	7.64	7.37	6.66	6.12	5.78	5.53	5.40 /	8.62
GHLC-31	10.28	9.79	7.72	7.72	7.40	6.72	6.02	5.69	5.43	5.31 /	8.30
GHLC-32	10.04	9.52	7.74	7.73	7.34	6.67	5.98	5.66	5.42	5.31 /	8.11
GHLC-33	10.38	9.89	7.84	7.75	7.38	6.72	6.01	5.70	5.46	5.36 /	8.38
GHLC-34	10.19	9.47	7.78	7.78	7.30	6.65	6.03	5.71	5.47	5.31 /	8.13
GHLC-35	10.26	9.56	7.82	7.81	7.30	6.64	6.02	5.69	5.46	5.32 /	8.19
GHLC-36	10.60	10.02	8.05	7.80	7.28	6.73	6.09	5.76	5.51	5.37 /	8.71
GHLC-37	10.49	9.84	8.01	7.82	7.35	6.74	6.08	5.74	5.49	5.37 /	8.55
GHLC-38	10.84	10.20	8.17	7.86	7.48	6.83	6.08	5.75	5.50	5.43 /	8.82
GHLC-39	10.63	9.98	8.07	7.87	7.43	6.77	6.14	5.78	5.51	5.39 /	8.75
GHLC-40	11.31	10.60	8.40	7.85	7.56	6.85	6.08	5.80	5.52	5.47 /	9.13
GHLC-41	10.75	10.07	8.12	7.91	7.45	6.78	6.14	5.80	5.54	5.42 /	8.84
GHLC-42	11.17	10.53	8.29	7.90	7.49	6.88	6.23	5.81	5.53	5.51 /	9.27
GHLC-43	11.69	11.09	8.52	7.93	7.56	6.99	6.16	5.84	5.55	5.58 /	9.53
GHLC-44	12.57	12.31	9.61	8.41	7.74	6.96	6.21	5.90	5.58	5.73 /	10.16
GHLC-45	12.24	11.33	9.05	8.08	7.67	7.02	6.27	5.92	5.54	5.66 /	9.90
GHLC-46	12.23	12.03	9.28	8.22	7.60	7.04	6.23	5.91	5.56	5.67 /	10.15
GHLC-47	12.38	12.05	9.27	8.23	7.64	7.02	6.24	5.92	5.55	5.69 /	10.07
GHLC-48	11.59	10.74	8.50	8.06	7.54	6.77	6.27	5.83	5.49	5.54 /	9.60
GHLC-49	11.63	10.76	8.46	8.09	7.53	6.75	6.23	5.82	5.50	5.54 /	9.54
GHLC-50	12.39	12.00	9.39	8.27	7.64	6.94	6.36	5.99	5.53	5.68 /	10.21
GHLC-51	11.91	11.26	8.79	8.11	7.56	6.79	6.29	5.88	5.51	5.59 /	9.74
GHLC-52	11.51	10.67	8.40	8.08	7.53	6.78	6.30	5.78	5.51	5.55 /	9.46
GHLC-53	11.73	11.07	8.74	8.11	7.54	6.83	6.35	5.82	5.53	5.59 /	9.82
JHF-S1	12.82	12.15	10.53	8.51	7.37	6.55	5.87	5.10	4.55	5.01 /	9.75
JHF-S2	12.95	12.32	10.62	8.59	7.43	6.57	5.87	5.10	4.55	5.01 /	9.77
JHF-S3	12.89	11.85	10.58	8.65	7.49	6.58	5.87	5.12	4.55	5.03 /	9.74
JHF-S4	12.69	12.09	10.17	8.34	7.25	6.61	6.03	5.07	4.96	5.01 /	9.50
JHF-S5	12.50	11.26	9.86	8.15	7.02	6.53	6.03	5.16	5.06	4.98 /	9.32
JHF-S6	12.56	11.11	9.95	8.21	7.09	6.56	6.04	5.15	5.06	4.99 /	9.33
JHF-S7	12.34	11.76	9.92	8.20	7.07	6.56	6.02	5.19	5.09	5.00 /	9.34
JHF-S8	11.75	11.09	9.01	7.65	6.58	6.35	5.84	5.51	5.37	4.97 /	8.92
JHF-S9	11.51	11.05	9.01	7.65	6.60	6.35	5.84	5.52	5.39	4.98 /	8.92
JHF-S10	11.03	10.72	8.53	7.77	7.34	6.45	5.94	5.77	5.31	5.12 /	8.52
JHF-S11	11.73	10.76	8.93	7.95	7.40	6.51	6.08	5.84	5.47	5.31 /	8.89
JHF-S12	11.94	11.19	9.58	8.06	7.75	6.96	6.46	5.87	5.54	5.40 /	9.34
JHF-S13	7.82	7.56	7.56	7.19	6.35	5.26	4.57	3.89	3.34	2.98 /	7.56
GHLC-S1	12.43	11.94	9.94	8.20	7.13	6.51	5.98	5.15	4.55	5.09 /	9.81
GHLC-S2	12.42	11.88	9.86	7.93	7.12	6.48	5.94	5.12	4.54	5.07 /	9.76
GHLC-S3	12.47	11.94	10.08	8.02	7.15	6.47	5.99	5.15	4.57	5.11 /	9.82
GHLC-S4	12.56	12.00	10.22	7.90	7.08	6.27	5.96	5.14	4.55	5.06 /	9.84
GHLC-S5	12.49	11.94	10.18	7.86	7.06	6.29	5.94	5.12	4.54	5.03 /	9.84
GHLC-S6	12.56	12.41	10.53	8.40	7.32	6.39	5.91	5.11	4.55	5.02 /	9.84
GHLC-S7	12.56	12.36	10.46	8.43	7.34	6.40	5.92	5.11	4.56	5.02 /	9.84
GHLC-S8	12.56	12.32	10.48	8.47	7.31	6.42	5.91	5.11	4.55	5.03 /	9.84
GHLC-S9	12.50	12.35	10.35	8.47	7.31	6.44	5.91	5.11	4.55	5.01 /	9.81
GHLC-S10	12.50	12.37	10.46	8.57	7.32	6.46	5.89	5.11	4.55	5.00 /	9.84

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（年始の最初の発表は、年末の最終営業日の午前11時現在、以下同じ。）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。