

PSJ 予測統計値
(平均値)

2010年 8月 2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	13.44	12.72	11.28	9.95	8.91	8.10	7.48	6.83	6.54	6.83 / 11.15		
JHF-2	13.44	12.68	11.29	9.95	8.87	8.08	7.46	6.83	6.54	6.79 / 11.13		
JHF-3	13.56	12.80	11.40	10.03	8.94	8.13	7.50	6.86	6.57	7.05 / 11.28		
JHF-4	13.72	13.00	11.54	10.17	9.00	8.16	7.52	6.85	6.56	7.22 / 11.22		
JHF-5	14.15	13.35	11.89	10.42	9.19	8.29	7.64	6.90	6.59	7.55 / 11.66		
JHF-6	13.96	13.17	11.65	10.20	9.05	8.20	7.58	6.88	6.58	7.13 / 11.44		
JHF-7	13.16	12.44	10.98	9.68	8.70	7.98	7.40	6.81	6.54	6.39 / 10.95		
JHF-8	13.90	13.08	11.61	10.15	9.01	8.18	7.54	6.88	6.59	7.05 / 11.41		
JHF-9	13.31	12.62	11.09	9.75	8.74	8.02	7.44	6.84	6.57	6.46 / 11.01		
JHF-10	12.74	12.08	10.69	9.43	8.52	7.85	7.31	6.78	6.53	6.04 / 10.70		
JHF-11	13.24	12.55	11.09	9.74	8.75	8.01	7.42	6.84	6.57	6.34 / 11.20		
JHF-12	13.13	12.47	10.98	9.67	8.69	7.96	7.40	6.82	6.56	6.38 / 11.07		
JHF-13	13.00	12.35	10.86	9.63	8.65	7.94	7.39	6.84	6.58	6.35 / 11.14		
JHF-14	12.72	12.04	10.61	9.38	8.52	7.83	7.32	6.81	6.56	6.24 / 10.82		
JHF-15	14.12	13.39	11.76	10.31	9.09	8.23	7.59	6.94	6.64	7.46 / 11.83		
JHF-16	14.71	13.89	12.29	10.71	9.37	8.40	7.71	6.97	6.65	8.01 / 12.22		
JHF-17	14.29	13.54	11.92	10.41	9.17	8.31	7.68	6.98	6.68	7.39 / 12.01		
JHF-18	13.97	13.26	11.67	10.18	9.01	8.21	7.58	6.93	6.65	7.17 / 11.69		
JHF-19	13.20	12.48	10.95	9.62	8.67	7.98	7.43	6.87	6.62	6.61 / 10.94		
JHF-20	13.30	12.64	11.08	9.72	8.74	8.04	7.48	6.91	6.65	6.73 / 11.09		
JHF-21	13.78	13.06	11.41	9.98	8.88	8.13	7.54	6.94	6.67	6.96 / 11.45		
JHF-22	13.84	13.14	11.48	10.01	8.90	8.14	7.56	6.96	6.69	7.13 / 11.58		
JHF-23	14.58	13.84	12.07	10.44	9.20	8.31	7.69	7.02	6.73	7.70 / 12.10		
JHF-24	14.22	13.50	11.75	10.21	9.05	8.24	7.64	7.01	6.73	7.23 / 11.96		
JHF-25	14.29	13.47	11.70	10.20	9.03	8.23	7.64	7.01	6.73	7.22 / 11.84		
JHF-26	14.72	13.90	12.11	10.42	9.18	8.33	7.69	7.03	6.74	7.84 / 11.90		
JHF-27	14.33	13.54	11.72	10.16	9.03	8.26	7.66	7.03	6.76	7.16 / 11.70		
JHF-28	13.49	12.72	11.01	9.63	8.72	8.06	7.52	6.98	6.73	6.62 / 11.11		
JHF-29	13.23	12.54	10.85	9.54	8.66	8.00	7.50	6.99	6.74	6.50 / 10.91		
JHF-30	12.88	12.18	10.61	9.39	8.56	7.95	7.46	6.99	6.75	6.49 / 10.63		
JHF-31	12.67	12.04	10.41	9.25	8.50	7.90	7.44	6.99	6.76	6.38 / 10.46		
JHF-32	13.00	12.31	10.67	9.46	8.64	8.01	7.53	7.05	6.80	6.46 / 10.83		
JHF-33	12.69	12.00	10.43	9.28	8.52	7.93	7.48	7.04	6.80	6.36 / 10.54		
JHF-34	12.69	12.06	10.46	9.31	8.57	7.96	7.52	7.07	6.84	6.28 / 10.73		
JHF-35	11.51	10.87	9.51	8.63	8.09	7.64	7.32	6.97	6.77	5.87 / 9.66		
JHF-36	11.30	10.67	9.35	8.56	8.03	7.61	7.30	6.98	6.78	5.81 / 9.58		
JHF-37	11.34	10.70	9.38	8.53	8.04	7.63	7.32	6.98	6.79	5.81 / 9.64		
JHF-38	11.15	10.49	9.18	8.45	7.96	7.59	7.30	6.98	6.79	5.72 / 9.62		
JHF-39	10.76	10.12	8.99	8.28	7.85	7.51	7.25	6.95	6.76	5.57 / 9.57		
GHLC-1	12.35	11.78	11.11	9.95	8.52	7.25	6.32	5.25	4.79	5.16 / 10.76		
GHLC-2	12.43	11.81	11.17	9.88	8.48	7.25	6.32	5.31	4.86	5.48 / 10.55		
GHLC-3	12.42	11.81	11.13	9.89	8.41	7.17	6.29	5.33	4.91	5.67 / 10.26		
GHLC-4	12.54	11.95	11.23	9.93	8.46	7.21	6.35	5.41	5.01	6.03 / 10.53		
GHLC-5	12.55	11.97	11.30	9.93	8.44	7.22	6.38	5.47	5.09	5.98 / 10.48		
GHLC-6	12.64	12.08	11.30	9.89	8.42	7.25	6.42	5.52	5.15	6.29 / 10.23		
GHLC-7	12.57	12.02	11.23	9.81	8.35	7.18	6.37	5.50	5.13	6.20 / 9.86		
GHLC-8	12.59	12.01	11.22	9.83	8.34	7.19	6.40	5.54	5.19	6.37 / 9.95		
GHLC-9	12.41	11.88	11.10	9.62	8.16	7.07	6.33	5.52	5.18	6.37 / 9.76		
GHLC-10	12.33	11.80	10.91	9.48	8.05	6.99	6.29	5.51	5.19	6.49 / 9.64		
GHLC-11	12.19	11.66	10.70	9.26	7.86	6.89	6.25	5.53	5.24	6.27 / 9.78		
GHLC-12	11.97	11.49	10.49	8.96	7.68	6.81	6.21	5.53	5.27	6.11 / 9.23		

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	12.07	11.58	10.60	9.07	7.75	6.85	6.23	5.54	5.28	5.96 / 9.68	
GHLC-14	12.14	11.61	10.62	9.15	7.82	6.89	6.27	5.55	5.28	6.14 / 9.35	
GHLC-15	12.10	11.55	10.52	9.10	7.76	6.86	6.25	5.54	5.27	6.01 / 9.36	
GHLC-16	12.09	11.51	10.55	9.05	7.73	6.85	6.24	5.56	5.29	6.08 / 9.40	
GHLC-17	12.09	11.58	10.55	9.11	7.76	6.89	6.28	5.59	5.33	5.96 / 9.29	
GHLC-18	12.09	11.55	10.54	9.04	7.77	6.88	6.28	5.60	5.35	6.10 / 9.15	
GHLC-19	12.01	11.48	10.41	8.95	7.71	6.85	6.25	5.58	5.33	6.07 / 9.05	
GHLC-20	12.09	11.55	10.47	8.98	7.77	6.94	6.32	5.66	5.40	5.88 / 9.13	
GHLC-21	12.06	11.59	10.41	8.96	7.79	6.96	6.36	5.70	5.44	5.96 / 9.25	
GHLC-22	12.21	11.69	10.56	9.05	7.85	6.99	6.38	5.70	5.44	6.06 / 9.48	
GHLC-23	12.32	11.72	10.55	9.11	7.90	7.03	6.40	5.73	5.46	6.06 / 9.49	
GHLC-24	12.23	11.70	10.51	9.09	7.90	7.07	6.44	5.77	5.50	5.97 / 9.59	
GHLC-25	12.09	11.55	10.38	8.95	7.83	7.04	6.44	5.78	5.52	5.95 / 9.59	
GHLC-26	11.92	11.36	10.22	8.77	7.67	6.92	6.33	5.72	5.47	5.84 / 9.14	
GHLC-27	11.16	10.62	9.48	8.34	7.46	6.79	6.24	5.72	5.48	5.34 / 9.26	
GHLC-28	11.86	11.28	10.05	8.70	7.65	6.91	6.33	5.73	5.49	5.66 / 9.31	
GHLC-29	11.12	10.52	9.40	8.30	7.43	6.76	6.23	5.72	5.48	5.35 / 9.25	
GHLC-30	10.92	10.40	9.30	8.29	7.41	6.73	6.22	5.71	5.48	5.42 / 9.29	
GHLC-31	10.81	10.27	9.11	8.11	7.30	6.67	6.18	5.70	5.47	5.23 / 9.08	
GHLC-32	10.54	10.03	8.94	8.02	7.23	6.63	6.16	5.71	5.49	5.20 / 8.95	
GHLC-33	10.91	10.35	9.24	8.17	7.36	6.70	6.20	5.70	5.48	5.26 / 9.15	
GHLC-34	10.62	10.07	8.98	8.06	7.25	6.62	6.16	5.70	5.48	5.15 / 8.89	
GHLC-35	10.79	10.20	9.11	8.09	7.30	6.65	6.18	5.71	5.49	5.24 / 8.93	
GHLC-36	11.24	10.69	9.45	8.35	7.50	6.79	6.27	5.75	5.51	5.48 / 9.16	
GHLC-37	11.15	10.55	9.35	8.28	7.43	6.74	6.23	5.73	5.50	5.37 / 9.05	
GHLC-38	11.54	10.92	9.67	8.51	7.59	6.87	6.32	5.77	5.52	5.65 / 9.25	
GHLC-39	11.36	10.73	9.50	8.39	7.50	6.79	6.26	5.73	5.49	5.47 / 9.09	
GHLC-40	11.84	11.25	9.94	8.68	7.73	6.96	6.38	5.78	5.52	5.94 / 9.40	
GHLC-41	11.44	10.85	9.61	8.44	7.55	6.85	6.29	5.76	5.51	5.58 / 9.14	
GHLC-42	11.86	11.25	9.91	8.73	7.72	6.96	6.37	5.78	5.52	6.03 / 9.39	
GHLC-43	12.32	11.65	10.27	8.99	7.92	7.10	6.47	5.83	5.55	6.41 / 9.62	
GHLC-44	12.95	12.27	10.83	9.45	8.25	7.32	6.62	5.89	5.59	6.75 / 9.95	
GHLC-45	12.75	12.04	10.62	9.22	8.09	7.22	6.54	5.85	5.56	6.56 / 9.74	
GHLC-46	12.87	12.18	10.76	9.35	8.14	7.26	6.58	5.87	5.57	6.60 / 9.75	
GHLC-47	12.91	12.18	10.76	9.35	8.15	7.27	6.62	5.88	5.58	6.60 / 9.72	
GHLC-48	12.23	11.56	10.17	8.86	7.81	7.04	6.46	5.82	5.54	5.98 / 9.28	
GHLC-49	12.27	11.60	10.19	8.89	7.82	7.04	6.46	5.83	5.55	6.17 / 9.26	
GHLC-50	12.95	12.20	10.77	9.32	8.15	7.27	6.62	5.89	5.59	6.55 / 9.84	
GHLC-51	12.52	11.86	10.36	9.00	7.91	7.10	6.50	5.84	5.55	6.26 / 9.40	
GHLC-52	12.14	11.45	10.04	8.80	7.75	7.00	6.41	5.80	5.53	5.98 / 9.15	
GHLC-53	12.44	11.77	10.26	8.94	7.88	7.08	6.48	5.83	5.56	6.23 / 9.43	
JHF-S1	12.35	11.76	10.91	9.70	8.39	7.27	6.45	5.54	5.14	6.90 / 9.90	
JHF-S2	12.28	11.74	10.90	9.68	8.37	7.24	6.44	5.53	5.14	6.88 / 9.69	
JHF-S3	12.26	11.72	10.87	9.65	8.36	7.25	6.44	5.53	5.13	6.90 / 9.77	
JHF-S4	12.09	11.60	10.68	9.37	8.10	7.08	6.36	5.55	5.21	6.50 / 9.50	
JHF-S5	11.95	11.43	10.53	9.15	7.92	6.94	6.29	5.54	5.23	6.24 / 9.22	
JHF-S6	12.03	11.49	10.57	9.25	7.96	6.97	6.31	5.55	5.24	6.30 / 9.25	
JHF-S7	12.04	11.50	10.52	9.22	7.94	6.95	6.30	5.54	5.24	6.27 / 9.19	
JHF-S8	11.66	11.12	10.15	8.75	7.56	6.77	6.21	5.57	5.33	5.82 / 8.65	
JHF-S9	11.67	11.15	10.15	8.76	7.56	6.78	6.22	5.58	5.34	5.83 / 8.66	
JHF-S10	11.51	11.01	9.88	8.51	7.52	6.81	6.27	5.69	5.45	5.63 / 8.67	
JHF-S11	11.96	11.42	10.25	8.84	7.75	6.98	6.40	5.76	5.51	6.01 / 9.29	
JHF-S12	12.16	11.59	10.36	8.93	7.85	7.06	6.45	5.81	5.55	6.16 / 9.42	
JHF-S13	7.62	7.43	6.99	6.30	5.59	5.01	4.58	4.07	3.77	2.84 / 8.84	
JHF-S14	7.64	7.46	7.00	6.29	5.60	5.03	4.60	4.08	3.78	2.82 / 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	7.41	6.97	6.30	5.58	5.01	4.57	4.04	3.75	2.81 / 8.59
JHF-S16	8.08	7.91	7.40	6.70	5.91	5.28	4.80	4.17	3.90	3.17 / 8.67
JHF-S17	8.09	7.91	7.36	6.66	5.90	5.26	4.79	4.16	3.90	3.12 / 8.52
JHF-S18	8.08	7.84	7.41	6.70	5.91	5.27	4.80	4.16	3.90	3.11 / 8.45
GHLC-S1	12.02	11.46	10.69	9.55	8.31	7.20	6.34	5.33	4.88	6.63 / 10.57
GHLC-S2	11.97	11.36	10.62	9.48	8.27	7.17	6.32	5.32	4.88	6.72 / 10.67
GHLC-S3	12.04	11.45	10.68	9.54	8.31	7.21	6.34	5.35	4.91	6.68 / 10.64
GHLC-S4	12.19	11.62	10.85	9.67	8.37	7.24	6.40	5.44	5.02	6.78 / 10.65
GHLC-S5	12.14	11.55	10.74	9.57	8.34	7.22	6.37	5.42	4.99	6.86 / 10.53
GHLC-S6	12.28	11.73	10.93	9.78	8.47	7.32	6.46	5.50	5.08	6.98 / 10.19
GHLC-S7	12.30	11.76	10.90	9.70	8.44	7.30	6.45	5.50	5.07	7.00 / 10.18
GHLC-S8	12.27	11.70	10.93	9.71	8.45	7.31	6.46	5.50	5.07	7.07 / 10.16
GHLC-S9	12.29	11.68	10.92	9.70	8.44	7.30	6.46	5.50	5.08	7.07 / 10.16
GHLC-S10	12.26	11.71	10.91	9.72	8.43	7.30	6.46	5.50	5.09	7.05 / 10.09

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。