

P S J 予測統計値
(中央値)

2010年 9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	13.90	13.08	11.17	9.70	9.04	7.92	7.43	7.10	6.75	6.82 / 10.97		
JHF-2	13.12	13.16	11.08	9.62	9.07	8.03	7.40	7.09	6.75	6.79 / 10.91		
JHF-3	13.85	13.18	11.12	9.83	9.09	7.98	7.45	7.10	6.76	7.02 / 11.04		
JHF-4	14.14	13.41	11.31	9.97	9.19	8.13	7.46	7.10	6.75	7.33 / 11.01		
JHF-5	14.08	13.89	11.62	10.20	9.22	8.15	7.51	7.11	6.80	7.53 / 11.42		
JHF-6	13.69	13.57	11.43	10.07	9.27	8.17	7.55	7.09	6.84	7.14 / 11.23		
JHF-7	13.36	12.64	10.59	9.65	8.85	7.99	7.55	7.01	6.74	6.39 / 10.75		
JHF-8	13.61	13.45	11.29	9.96	9.23	8.19	7.49	7.05	6.81	7.01 / 11.19		
JHF-9	13.78	13.06	10.75	9.68	8.79	7.97	7.46	7.04	6.74	6.45 / 10.84		
JHF-10	13.25	12.48	10.18	9.40	8.53	8.00	7.43	6.98	6.66	6.12 / 10.52		
JHF-11	13.33	12.94	10.70	9.66	8.89	8.13	7.49	6.99	6.75	6.38 / 10.98		
JHF-12	13.73	12.60	10.55	9.57	8.80	8.08	7.48	6.99	6.70	6.37 / 10.86		
JHF-13	13.74	12.46	10.45	9.49	8.69	7.99	7.49	6.97	6.71	6.32 / 10.93		
JHF-14	12.71	12.28	10.11	9.35	8.56	7.86	7.45	6.98	6.67	6.24 / 10.59		
JHF-15	13.88	13.49	11.37	9.94	9.18	8.15	7.63	7.02	6.84	7.38 / 11.59		
JHF-16	14.69	14.13	11.85	10.18	9.36	8.40	7.68	7.09	6.90	7.92 / 11.97		
JHF-17	14.06	13.50	11.26	10.05	9.10	8.25	7.66	7.13	6.86	7.38 / 11.77		
JHF-18	14.09	13.29	10.95	9.83	8.92	8.15	7.59	7.09	6.80	7.18 / 11.44		
JHF-19	13.71	12.75	10.41	9.45	8.64	7.91	7.52	7.07	6.68	6.58 / 10.73		
JHF-20	13.73	12.92	10.54	9.49	8.67	7.92	7.54	7.08	6.71	6.73 / 10.88		
JHF-21	13.85	13.06	10.77	9.61	8.75	7.98	7.58	7.13	6.76	7.07 / 11.21		
JHF-22	13.81	13.30	10.74	9.60	8.73	7.96	7.50	7.10	6.76	7.08 / 11.33		
JHF-23	14.44	13.86	11.04	9.87	8.88	8.13	7.59	7.12	6.81	7.64 / 11.84		
JHF-24	14.00	13.47	10.95	9.73	8.80	8.05	7.55	7.13	6.78	7.23 / 11.70		
JHF-25	14.09	13.50	10.76	9.71	8.77	8.04	7.56	7.16	6.76	7.21 / 11.58		
JHF-26	14.75	13.94	10.97	9.87	8.81	8.12	7.54	7.02	6.82	7.74 / 11.66		
JHF-27	14.30	13.79	10.76	9.77	8.73	8.10	7.54	7.09	6.80	7.22 / 11.46		
JHF-28	13.52	13.16	10.26	9.31	8.55	7.98	7.66	7.14	6.73	6.59 / 10.88		
JHF-29	13.44	12.93	10.19	9.21	8.48	7.95	7.65	7.11	6.75	6.49 / 10.69		
JHF-30	13.20	12.44	9.89	9.10	8.38	7.91	7.66	7.08	6.76	6.45 / 10.41		
JHF-31	12.92	12.09	9.71	9.00	8.33	7.94	7.63	7.03	6.77	6.37 / 10.22		
JHF-32	13.13	12.54	9.91	9.16	8.44	7.99	7.71	7.13	6.76	6.43 / 10.57		
JHF-33	12.62	11.99	9.68	9.01	8.36	7.99	7.63	7.08	6.81	6.31 / 10.28		
JHF-34	12.74	12.04	9.74	9.03	8.40	8.02	7.66	7.10	6.85	6.31 / 10.48		
JHF-35	11.92	10.22	8.94	8.35	8.00	7.76	7.26	6.98	6.82	5.91 / 9.60		
JHF-36	11.57	9.95	8.81	8.24	7.96	7.75	7.24	6.98	6.83	5.86 / 9.52		
JHF-37	11.54	10.05	8.84	8.22	7.97	7.76	7.28	7.02	6.86	5.91 / 9.58		
JHF-38	11.18	9.74	8.71	8.20	7.93	7.75	7.26	7.02	6.87	5.79 / 9.58		
JHF-39	10.72	9.48	8.58	8.22	7.89	7.75	7.27	7.06	6.90	5.65 / 9.54		
JHF-40	10.30	9.26	8.39	8.16	7.87	7.76	7.27	7.06	6.93	5.57 / 9.49		
GHLC-1	12.55	12.55	11.69	10.40	8.35	6.86	6.44	5.63	4.95	5.00 / 10.72		
GHLC-2	12.57	12.57	11.77	10.40	8.29	6.76	6.52	5.57	4.98	5.42 / 10.51		
GHLC-3	12.71	12.71	11.75	10.27	8.05	6.85	6.59	5.48	4.99	5.63 / 10.24		
GHLC-4	12.41	12.41	11.64	9.92	8.46	6.87	6.48	5.60	4.97	5.93 / 10.45		
GHLC-5	12.48	12.48	11.82	9.86	8.41	6.76	6.54	5.61	5.05	5.91 / 10.45		
GHLC-6	12.73	12.73	11.52	9.84	8.40	6.98	6.60	5.56	5.09	6.24 / 10.22		
GHLC-7	12.93	12.93	11.69	9.92	8.50	7.13	6.60	5.59	5.10	6.15 / 9.82		
GHLC-8	12.88	12.88	11.57	9.80	8.47	7.09	6.62	5.56	5.10	6.31 / 9.90		
GHLC-9	12.95	12.95	11.43	9.61	8.17	6.91	6.54	5.61	5.10	6.30 / 9.65		
GHLC-10	12.74	12.74	11.11	9.38	8.10	6.89	6.42	5.57	5.15	6.45 / 9.59		
GHLC-11	12.39	12.39	10.58	9.13	7.97	6.88	6.30	5.49	5.26	6.20 / 9.74		

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-12	12.28	12.28	10.05	8.85	7.96	6.89	6.25	5.46	5.34	6.05 / 9.19	
GHLC-13	12.38	12.38	10.28	8.99	8.00	6.96	6.30	5.49	5.32	5.88 / 9.37	
GHLC-14	12.45	12.45	10.43	9.07	8.03	6.93	6.34	5.51	5.33	6.07 / 9.14	
GHLC-15	12.36	12.36	10.23	8.98	7.95	6.90	6.29	5.49	5.39	6.10 / 9.18	
GHLC-16	12.33	12.33	10.21	8.95	8.00	6.93	6.28	5.53	5.45	5.94 / 9.08	
GHLC-17	12.29	12.29	10.17	8.94	8.00	6.92	6.28	5.54	5.42	5.93 / 9.12	
GHLC-18	12.21	12.21	10.15	8.86	7.97	6.94	6.29	5.59	5.48	6.07 / 9.02	
GHLC-19	12.09	12.09	9.89	8.78	7.89	6.85	6.27	5.57	5.46	6.00 / 8.98	
GHLC-20	12.03	12.03	9.80	8.79	7.84	6.92	6.37	5.69	5.47	5.83 / 9.11	
GHLC-21	12.04	12.04	9.81	8.80	7.85	7.07	6.37	5.74	5.52	6.02 / 9.00	
GHLC-22	12.24	12.04	10.16	8.96	7.99	7.11	6.39	5.71	5.58	6.02 / 9.15	
GHLC-23	12.22	12.21	10.06	8.95	7.91	7.11	6.43	5.78	5.56	6.02 / 9.11	
GHLC-24	12.16	12.11	9.95	8.84	7.91	7.14	6.48	5.82	5.60	5.92 / 9.19	
GHLC-25	11.93	11.93	9.76	8.38	7.83	7.16	6.50	5.87	5.55	5.89 / 9.25	
GHLC-26	11.72	11.72	9.47	8.61	7.64	6.96	6.51	5.80	5.43	5.77 / 8.77	
GHLC-27	10.85	10.60	9.10	7.93	7.39	6.98	6.41	5.92	5.48	5.46 / 8.99	
GHLC-28	11.52	11.52	9.44	8.11	7.63	7.05	6.42	5.89	5.46	5.63 / 9.06	
GHLC-29	10.80	10.48	9.05	7.93	7.36	6.92	6.38	5.91	5.46	5.33 / 9.04	
GHLC-30	10.34	10.24	8.66	8.00	7.35	6.83	6.33	5.87	5.54	5.40 / 9.09	
GHLC-31	10.32	10.07	8.65	7.86	7.42	6.74	6.37	5.78	5.46	5.25 / 8.91	
GHLC-32	10.24	9.69	8.49	7.81	7.34	6.74	6.28	5.76	5.47	5.17 / 8.81	
GHLC-33	10.47	10.31	8.88	7.89	7.45	6.77	6.39	5.82	5.43	5.37 / 8.97	
GHLC-34	10.34	10.12	8.42	7.81	7.37	6.68	6.24	5.75	5.45	5.15 / 8.82	
GHLC-35	10.35	10.31	8.44	7.81	7.34	6.69	6.27	5.73	5.44	5.22 / 8.77	
GHLC-36	11.15	10.73	8.97	8.00	7.53	6.90	6.42	5.84	5.53	5.46 / 8.98	
GHLC-37	11.03	10.60	8.86	7.99	7.48	6.82	6.41	5.80	5.51	5.38 / 8.90	
GHLC-38	11.70	11.05	9.13	8.19	7.60	7.00	6.50	5.87	5.50	5.66 / 9.09	
GHLC-39	11.43	10.99	8.99	8.10	7.53	6.97	6.42	5.83	5.52	5.48 / 8.98	
GHLC-40	11.98	11.39	9.34	8.27	7.67	7.13	6.52	5.93	5.51	5.92 / 9.25	
GHLC-41	11.45	11.06	9.05	8.09	7.55	7.01	6.37	5.82	5.54	5.57 / 9.00	
GHLC-42	11.95	11.47	9.36	8.27	7.71	7.18	6.46	5.93	5.59	6.02 / 9.26	
GHLC-43	12.29	11.88	9.80	8.46	7.84	7.31	6.55	6.01	5.60	6.29 / 9.46	
GHLC-44	12.62	12.62	10.63	8.78	8.05	7.32	6.62	6.09	5.65	6.61 / 9.79	
GHLC-45	12.47	12.34	10.20	8.76	7.96	7.41	6.54	6.04	5.59	6.43 / 9.59	
GHLC-46	12.35	12.35	10.32	8.90	8.03	7.40	6.63	6.04	5.60	6.46 / 9.60	
GHLC-47	13.12	12.36	10.27	8.90	8.04	7.43	6.62	6.04	5.56	6.46 / 9.55	
GHLC-48	12.19	11.89	9.58	8.45	7.72	7.13	6.45	5.88	5.57	6.00 / 9.13	
GHLC-49	12.91	12.01	9.62	8.42	7.73	7.10	6.44	5.85	5.57	6.05 / 9.09	
GHLC-50	12.63	12.40	10.24	8.83	8.05	7.45	6.67	6.03	5.62	6.41 / 9.60	
GHLC-51	12.66	11.68	9.85	8.53	7.84	7.20	6.50	5.91	5.56	6.14 / 9.22	
GHLC-52	12.40	11.44	9.47	8.39	7.81	7.01	6.43	5.80	5.57	6.00 / 8.95	
GHLC-53	12.16	12.08	9.67	8.48	7.79	7.12	6.47	5.86	5.62	6.10 / 9.19	
JHF-S1	12.23	12.23	10.76	9.56	8.30	6.88	6.44	5.61	5.26	6.79 / 9.84	
JHF-S2	12.22	12.22	10.72	9.53	8.25	6.88	6.44	5.58	5.29	6.78 / 9.70	
JHF-S3	12.26	12.26	10.59	9.54	8.22	6.96	6.45	5.56	5.33	6.79 / 9.58	
JHF-S4	12.08	12.08	10.24	8.98	7.94	6.78	6.38	5.59	5.48	6.39 / 9.38	
JHF-S5	11.93	11.93	9.90	8.79	7.84	6.74	6.25	5.65	5.41	6.12 / 9.18	
JHF-S6	11.98	11.98	9.97	8.83	7.88	6.73	6.27	5.65	5.43	6.18 / 9.15	
JHF-S7	12.02	12.02	9.88	8.80	7.89	6.73	6.28	5.65	5.43	6.15 / 9.10	
JHF-S8	11.72	11.48	9.21	8.46	7.66	6.69	6.11	5.81	5.35	5.70 / 8.62	
JHF-S9	11.70	11.46	9.22	8.49	7.65	6.70	6.12	5.83	5.35	5.72 / 8.64	
JHF-S10	11.22	11.03	8.95	8.44	7.54	6.89	6.26	5.89	5.34	5.53 / 8.39	
JHF-S11	12.00	11.22	9.36	8.45	7.64	7.23	6.27	6.04	5.51	5.87 / 9.05	
JHF-S12	12.73	11.58	9.47	8.51	7.78	7.22	6.45	6.07	5.54	6.00 / 9.22	
JHF-S13	7.53	7.53	7.46	6.95	6.20	5.21	4.88	4.48	3.78	2.88 / 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-S14	7.55	7.55	7.53	6.93	6.25	5.23	4.85	4.44	3.79	2.85 /	8.77
JHF-S15	7.59	7.59	7.52	6.94	6.23	5.30	4.89	4.45	3.79	2.85 /	8.69
JHF-S16	8.01	8.01	7.79	7.24	6.53	5.64	5.05	4.60	3.95	3.21 /	8.76
JHF-S17	8.00	8.00	7.76	7.26	6.50	5.63	5.01	4.60	3.97	3.15 /	8.62
JHF-S18	8.02	8.02	7.78	7.29	6.52	5.64	5.02	4.55	3.97	3.14 /	8.54
GHLC-S1	11.80	11.80	10.83	9.29	7.73	6.69	6.38	5.54	5.09	6.59 /	10.50
GHLC-S2	11.72	11.72	10.79	9.25	7.68	6.66	6.34	5.51	5.08	6.66 /	10.56
GHLC-S3	11.85	11.85	10.90	9.34	7.73	6.64	6.32	5.45	5.11	6.64 /	10.54
GHLC-S4	11.86	11.86	10.89	9.23	8.03	6.62	6.39	5.57	5.11	6.74 /	10.52
GHLC-S5	11.77	11.77	10.77	9.20	7.87	6.62	6.37	5.56	5.11	6.80 /	10.49
GHLC-S6	12.15	12.15	10.83	9.43	8.09	7.20	6.39	5.66	5.12	6.95 /	10.13
GHLC-S7	12.11	12.11	10.80	9.39	8.10	7.10	6.39	5.60	5.13	6.96 /	10.12
GHLC-S8	12.03	12.03	10.75	9.39	8.14	7.12	6.41	5.62	5.14	7.02 /	10.14
GHLC-S9	12.08	12.08	10.72	9.43	8.16	7.01	6.39	5.56	5.12	7.00 /	10.10
GHLC-S10	12.06	12.06	10.67	9.43	8.13	7.03	6.39	5.59	5.15	6.98 /	10.03

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。