

PSJ 予測統計値
(平均値)

2010年 5月 6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	13.37	12.49	10.60	9.35	8.44	7.76	7.22	6.70	6.43	6.21 / 10.51	
JHF-2	13.30	12.44	10.60	9.33	8.41	7.73	7.20	6.69	6.44	6.18 / 10.44	
JHF-3	13.46	12.64	10.73	9.40	8.47	7.78	7.24	6.72	6.46	6.32 / 10.60	
JHF-4	13.68	12.80	10.86	9.50	8.52	7.81	7.26	6.72	6.46	6.54 / 10.53	
JHF-5	14.09	13.16	11.09	9.72	8.67	7.92	7.35	6.76	6.48	6.79 / 10.89	
JHF-6	13.85	12.89	10.90	9.50	8.55	7.85	7.29	6.74	6.46	6.52 / 10.72	
JHF-7	12.98	12.18	10.31	9.13	8.27	7.65	7.15	6.68	6.43	5.92 / 10.26	
JHF-8	13.75	12.88	10.85	9.46	8.51	7.81	7.27	6.73	6.47	6.31 / 10.67	
JHF-9	13.19	12.34	10.39	9.18	8.31	7.69	7.18	6.70	6.46	5.99 / 10.32	
JHF-10	12.62	11.81	10.00	8.92	8.14	7.55	7.10	6.67	6.43	5.76 / 10.05	
JHF-11	13.13	12.36	10.44	9.16	8.32	7.68	7.19	6.72	6.48	6.03 / 10.48	
JHF-12	13.06	12.26	10.32	9.09	8.28	7.64	7.18	6.71	6.47	6.03 / 10.39	
JHF-13	12.89	12.12	10.25	9.02	8.24	7.62	7.17	6.72	6.48	5.89 / 10.45	
JHF-14	12.57	11.78	10.01	8.87	8.14	7.53	7.12	6.70	6.47	5.85 / 10.15	
JHF-15	14.01	13.14	11.03	9.62	8.59	7.85	7.33	6.80	6.54	6.61 / 11.08	
JHF-16	14.67	13.74	11.50	9.93	8.82	8.02	7.42	6.83	6.57	7.44 / 11.44	
JHF-17	14.18	13.32	11.15	9.66	8.67	7.97	7.41	6.86	6.60	6.73 / 11.23	
JHF-18	13.85	13.05	10.91	9.49	8.54	7.86	7.33	6.82	6.57	6.62 / 10.95	
JHF-19	13.00	12.22	10.26	9.04	8.27	7.65	7.20	6.77	6.54	6.19 / 10.25	
JHF-20	13.22	12.40	10.41	9.14	8.34	7.72	7.26	6.81	6.57	6.31 / 10.41	
JHF-21	13.65	12.86	10.67	9.31	8.46	7.81	7.33	6.84	6.59	6.55 / 10.76	
JHF-22	13.72	12.90	10.68	9.37	8.48	7.80	7.35	6.86	6.62	6.63 / 10.86	
JHF-23	14.49	13.60	11.22	9.72	8.70	7.96	7.45	6.91	6.66	7.02 / 11.33	
JHF-24	14.14	13.24	10.95	9.51	8.59	7.89	7.42	6.91	6.65	6.68 / 11.24	
JHF-25	14.13	13.22	10.90	9.48	8.57	7.88	7.41	6.90	6.65	6.68 / 11.10	
JHF-26	14.59	13.71	11.26	9.69	8.70	7.99	7.47	6.94	6.68	7.05 / 11.14	
JHF-27	14.19	13.33	10.96	9.53	8.61	7.94	7.44	6.95	6.69	6.72 / 11.00	
JHF-28	13.31	12.49	10.33	9.08	8.37	7.78	7.34	6.91	6.68	6.36 / 10.46	
JHF-29	13.10	12.26	10.15	9.03	8.31	7.73	7.33	6.92	6.69	6.30 / 10.28	
JHF-30	12.72	11.93	9.95	8.87	8.23	7.68	7.32	6.91	6.70	6.27 / 10.03	
JHF-31	12.53	11.75	9.82	8.79	8.18	7.65	7.30	6.92	6.70	6.15 / 9.88	
JHF-32	12.90	12.08	10.00	8.94	8.30	7.74	7.37	6.97	6.75	6.22 / 10.20	
JHF-33	12.55	11.70	9.79	8.81	8.21	7.68	7.34	6.96	6.74	6.13 / 9.95	
JHF-34	12.59	11.80	9.87	8.90	8.25	7.72	7.39	7.00	6.79	6.12 / 10.13	
JHF-35	11.31	10.55	9.05	8.28	7.85	7.46	7.21	6.91	6.72	5.77 / 9.61	
JHF-36	11.05	10.34	8.84	8.16	7.75	7.39	7.16	6.87	6.68	5.73 / 9.55	
GHLC-1	12.23	11.58	10.62	9.16	7.87	6.78	5.99	5.12	4.76	5.69 / 9.64	
GHLC-2	12.32	11.62	10.58	9.10	7.80	6.75	5.99	5.16	4.80	5.90 / 9.47	
GHLC-3	12.37	11.65	10.58	9.07	7.77	6.71	6.00	5.20	4.86	5.92 / 9.50	
GHLC-4	12.37	11.73	10.61	9.05	7.74	6.70	6.03	5.27	4.94	6.20 / 9.41	
GHLC-5	12.33	11.78	10.68	9.05	7.75	6.74	6.09	5.33	5.04	6.16 / 9.50	
GHLC-6	12.46	11.84	10.65	9.10	7.75	6.76	6.12	5.39	5.08	6.08 / 9.27	
GHLC-7	12.43	11.83	10.65	9.04	7.68	6.73	6.09	5.37	5.08	6.03 / 8.95	
GHLC-8	12.45	11.84	10.60	8.97	7.69	6.75	6.12	5.41	5.13	6.01 / 9.02	
GHLC-9	12.31	11.72	10.40	8.80	7.55	6.65	6.07	5.39	5.13	5.89 / 8.88	
GHLC-10	12.20	11.63	10.25	8.64	7.45	6.60	6.03	5.39	5.14	5.79 / 8.75	
GHLC-11	12.07	11.46	10.01	8.49	7.31	6.56	6.02	5.42	5.18	5.41 / 8.82	
GHLC-12	11.89	11.34	9.77	8.27	7.20	6.50	6.00	5.45	5.22	5.39 / 8.39	
GHLC-13	11.94	11.43	9.85	8.34	7.25	6.52	6.01	5.45	5.22	5.55 / 8.82	
GHLC-14	12.04	11.45	9.91	8.40	7.29	6.56	6.04	5.45	5.21	5.31 / 8.56	
GHLC-15	11.95	11.40	9.88	8.40	7.26	6.54	6.03	5.46	5.23	5.35 / 8.60	

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-16	11.97	11.43	9.83	8.31	7.27	6.55	6.05	5.48	5.26	5.44 / 8.60	
GHLC-17	12.04	11.45	9.91	8.36	7.30	6.58	6.08	5.50	5.28	5.46 / 8.50	
GHLC-18	12.00	11.41	9.78	8.35	7.29	6.56	6.07	5.51	5.29	5.32 / 8.60	
GHLC-19	11.88	11.29	9.71	8.27	7.24	6.53	6.04	5.49	5.26	5.30 / 8.50	
GHLC-20	11.99	11.43	9.77	8.31	7.34	6.63	6.13	5.57	5.33	5.26 / 8.60	
GHLC-21	12.03	11.41	9.71	8.35	7.38	6.65	6.16	5.61	5.38	5.38 / 8.80	
GHLC-22	12.13	11.54	9.87	8.40	7.43	6.68	6.18	5.61	5.38	5.50 / 9.00	
GHLC-23	12.25	11.64	9.90	8.47	7.47	6.73	6.21	5.64	5.41	5.53 / 9.00	
GHLC-24	12.20	11.57	9.84	8.46	7.47	6.75	6.23	5.67	5.42	5.39 / 9.10	
GHLC-25	12.00	11.40	9.67	8.32	7.40	6.74	6.20	5.67	5.42	5.37 / 9.10	
GHLC-26	11.81	11.25	9.49	8.15	7.28	6.62	6.14	5.63	5.40	5.26 / 8.70	
GHLC-27	11.09	10.46	8.90	7.86	7.12	6.51	6.07	5.63	5.41	5.07 / 8.80	
GHLC-28	11.72	11.10	9.33	8.14	7.26	6.61	6.13	5.64	5.40	5.30 / 8.90	
GHLC-29	10.99	10.36	8.84	7.84	7.09	6.49	6.06	5.63	5.41	5.09 / 8.80	
GHLC-30	10.88	10.22	8.77	7.83	7.06	6.46	6.04	5.61	5.40	5.01 / 8.80	
GHLC-31	10.67	10.06	8.62	7.68	6.98	6.39	6.00	5.59	5.38	4.91 / 8.70	
GHLC-32	10.43	9.87	8.52	7.60	6.92	6.37	5.99	5.61	5.40	4.87 / 8.60	
GHLC-33	10.81	10.16	8.69	7.77	7.03	6.44	6.03	5.61	5.40	5.01 / 8.70	
GHLC-34	10.51	9.93	8.55	7.58	6.93	6.36	5.99	5.61	5.40	4.96 / 8.50	
GHLC-35	10.64	10.04	8.57	7.64	6.96	6.38	6.00	5.61	5.40	5.02 / 8.50	
GHLC-36	11.14	10.47	8.96	7.93	7.12	6.49	6.07	5.63	5.41	5.08 / 8.70	
GHLC-37	11.02	10.39	8.84	7.79	7.06	6.44	6.03	5.62	5.40	5.03 / 8.60	
GHLC-38	11.41	10.71	9.06	8.03	7.20	6.55	6.10	5.65	5.43	5.22 / 8.70	
GHLC-39	11.22	10.56	8.99	7.92	7.13	6.49	6.06	5.63	5.41	5.16 / 8.60	
GHLC-40	11.83	11.05	9.33	8.16	7.33	6.64	6.15	5.67	5.44	5.51 / 8.90	
GHLC-41	11.33	10.62	9.04	7.95	7.17	6.54	6.09	5.65	5.42	5.25 / 8.66	
GHLC-42	11.76	11.05	9.29	8.14	7.31	6.64	6.14	5.67	5.42	5.45 / 8.90	
GHLC-43	12.24	11.46	9.66	8.41	7.47	6.75	6.22	5.69	5.46	5.80 / 9.00	
GHLC-44	12.90	12.12	10.19	8.81	7.76	6.94	6.35	5.76	5.50	6.19 / 9.30	
GHLC-45	12.72	11.88	9.90	8.60	7.62	6.85	6.28	5.73	5.46	6.05 / 9.10	
GHLC-46	12.85	12.01	10.03	8.70	7.67	6.90	6.32	5.74	5.48	6.07 / 9.10	
GHLC-47	12.89	12.01	10.08	8.67	7.68	6.93	6.34	5.75	5.48	6.08 / 9.10	
GHLC-48	12.18	11.38	9.51	8.24	7.38	6.73	6.21	5.70	5.45	5.52 / 8.70	
GHLC-49	12.22	11.36	9.47	8.29	7.37	6.72	6.20	5.69	5.45	5.57 / 8.60	
GHLC-50	12.89	12.07	10.03	8.69	7.66	6.91	6.33	5.74	5.48	6.04 / 9.07	
GHLC-51	12.49	11.65	9.68	8.38	7.46	6.78	6.24	5.71	5.45	5.77 / 8.69	
GHLC-52	12.10	11.31	9.39	8.20	7.33	6.68	6.16	5.68	5.44	5.55 / 8.50	
GHLC-53	12.38	11.53	9.63	8.35	7.43	6.76	6.23	5.71	5.46	5.77 / 8.68	
JHF-S1	12.25	11.62	10.39	9.03	7.79	6.82	6.17	5.41	5.09	5.90 / 9.31	
JHF-S2	12.16	11.59	10.35	8.96	7.77	6.81	6.15	5.40	5.09	5.89 / 9.11	
JHF-S3	12.18	11.61	10.32	9.02	7.77	6.81	6.16	5.40	5.09	5.90 / 9.04	
JHF-S4	12.06	11.51	10.14	8.74	7.56	6.70	6.11	5.43	5.16	5.66 / 8.87	
JHF-S5	11.91	11.33	9.94	8.49	7.39	6.60	6.06	5.43	5.18	5.48 / 8.68	
JHF-S6	11.92	11.39	9.96	8.54	7.43	6.63	6.08	5.45	5.20	5.53 / 8.66	
JHF-S7	11.95	11.41	9.96	8.57	7.41	6.62	6.08	5.44	5.19	5.50 / 8.60	
JHF-S8	11.57	11.05	9.51	8.06	7.12	6.47	6.01	5.49	5.27	5.25 / 8.19	
JHF-S9	11.53	11.01	9.47	8.07	7.13	6.48	6.02	5.50	5.29	5.25 / 8.20	
JHF-S10	11.43	10.92	9.23	7.98	7.14	6.53	6.09	5.61	5.40	5.22 / 8.31	
JHF-S11	11.90	11.27	9.52	8.18	7.34	6.66	6.18	5.67	5.43	5.54 / 8.80	
JHF-S12	12.09	11.46	9.65	8.31	7.42	6.72	6.23	5.71	5.47	5.67 / 8.90	
JHF-S13	7.69	7.47	6.79	6.04	5.38	4.87	4.49	3.98	3.74	2.84 / 8.29	
JHF-S14	7.65	7.49	6.78	6.07	5.41	4.88	4.48	4.00	3.75	2.83 / 8.19	
JHF-S15	7.66	7.45	6.81	6.09	5.41	4.88	4.49	4.00	3.77	2.82 / 8.08	
JHF-S16	8.18	7.95	7.25	6.46	5.73	5.15	4.71	4.15	3.91	3.16 / 8.15	
JHF-S17	8.18	7.91	7.20	6.41	5.71	5.12	4.70	4.14	3.91	3.12 / 8.00	

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-S18	8.16	7.94	7.17	6.41	5.71	5.12	4.70	4.14	3.90	3.12 / 7.92
GHLC-S1	12.00	11.38	10.26	8.97	7.78	6.82	6.06	5.21	4.85	6.36 / 9.98
GHLC-S2	11.94	11.28	10.18	8.92	7.75	6.79	6.04	5.22	4.86	6.33 / 10.04
GHLC-S3	11.94	11.35	10.21	8.92	7.76	6.79	6.05	5.22	4.87	6.38 / 9.98
GHLC-S4	12.07	11.48	10.30	9.03	7.81	6.80	6.11	5.31	4.97	6.22 / 9.94
GHLC-S5	12.09	11.50	10.27	8.96	7.78	6.78	6.10	5.30	4.96	6.15 / 9.83
GHLC-S6	12.20	11.65	10.45	9.07	7.87	6.87	6.18	5.37	5.03	6.07 / 9.59
GHLC-S7	12.17	11.63	10.38	9.08	7.86	6.86	6.17	5.37	5.03	6.10 / 9.58
GHLC-S8	12.22	11.63	10.41	9.08	7.87	6.86	6.17	5.37	5.03	6.09 / 9.55
GHLC-S9	12.15	11.59	10.37	9.04	7.85	6.84	6.15	5.36	5.03	6.08 / 9.51
GHLC-S10	12.19	11.58	10.37	9.06	7.85	6.84	6.16	5.37	5.03	6.04 / 9.45

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。