

PSJ 予測統計値
(平均値)

2010年 6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・スタンレー、ゴールドマン・サックス、銀行・スタンレー・MUFG、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	13.43	12.61	10.85	9.56	8.60	7.88	7.31	6.75	6.49	6.48 / 10.59	
JHF-2	13.42	12.58	10.82	9.54	8.56	7.84	7.29	6.73	6.47	6.32 / 10.53	
JHF-3	13.53	12.69	10.96	9.63	8.62	7.90	7.32	6.76	6.49	6.49 / 10.67	
JHF-4	13.73	12.93	11.04	9.70	8.68	7.93	7.34	6.77	6.49	6.74 / 10.62	
JHF-5	14.13	13.24	11.33	9.90	8.84	8.04	7.45	6.81	6.52	7.02 / 11.02	
JHF-6	13.93	13.00	11.16	9.75	8.71	7.97	7.40	6.79	6.51	6.69 / 10.83	
JHF-7	13.07	12.28	10.50	9.29	8.41	7.77	7.24	6.74	6.48	6.09 / 10.35	
JHF-8	13.84	13.02	11.07	9.66	8.66	7.93	7.36	6.78	6.51	6.47 / 10.78	
JHF-9	13.22	12.45	10.64	9.30	8.44	7.80	7.26	6.75	6.50	6.05 / 10.45	
JHF-10	12.70	11.92	10.21	9.04	8.26	7.65	7.17	6.71	6.47	5.79 / 10.15	
JHF-11	13.21	12.46	10.64	9.33	8.46	7.79	7.27	6.76	6.52	6.08 / 10.60	
JHF-12	13.14	12.30	10.55	9.25	8.41	7.74	7.25	6.75	6.51	6.10 / 10.48	
JHF-13	12.94	12.20	10.46	9.22	8.37	7.73	7.25	6.77	6.53	6.06 / 10.54	
JHF-14	12.62	11.90	10.17	9.03	8.25	7.63	7.18	6.73	6.50	5.87 / 10.23	
JHF-15	14.08	13.22	11.24	9.76	8.74	7.97	7.41	6.84	6.58	6.78 / 11.19	
JHF-16	14.72	13.80	11.74	10.14	8.98	8.15	7.52	6.88	6.60	7.70 / 11.55	
JHF-17	14.24	13.41	11.37	9.88	8.81	8.08	7.49	6.90	6.63	6.89 / 11.35	
JHF-18	13.93	13.13	11.09	9.67	8.68	7.97	7.41	6.86	6.60	6.73 / 11.05	
JHF-19	13.13	12.35	10.50	9.24	8.40	7.77	7.29	6.81	6.57	6.32 / 10.37	
JHF-20	13.26	12.52	10.61	9.27	8.45	7.81	7.31	6.82	6.58	6.35 / 10.51	
JHF-21	13.75	12.96	10.88	9.49	8.57	7.90	7.38	6.86	6.61	6.59 / 10.85	
JHF-22	13.83	12.98	10.90	9.51	8.59	7.90	7.40	6.89	6.64	6.68 / 10.96	
JHF-23	14.53	13.66	11.47	9.92	8.84	8.05	7.52	6.94	6.67	7.12 / 11.45	
JHF-24	14.21	13.36	11.20	9.69	8.73	8.00	7.48	6.94	6.68	6.83 / 11.33	
JHF-25	14.17	13.32	11.16	9.66	8.69	7.98	7.46	6.92	6.67	6.70 / 11.22	
JHF-26	14.67	13.76	11.47	9.88	8.82	8.08	7.52	6.96	6.69	7.14 / 11.26	
JHF-27	14.24	13.40	11.15	9.65	8.71	8.02	7.49	6.96	6.69	6.73 / 11.12	
JHF-28	13.35	12.59	10.53	9.25	8.46	7.85	7.38	6.92	6.68	6.34 / 10.55	
JHF-29	13.18	12.41	10.34	9.15	8.41	7.80	7.37	6.93	6.69	6.29 / 10.36	
JHF-30	12.80	12.07	10.15	9.00	8.33	7.76	7.35	6.93	6.70	6.26 / 10.13	
JHF-31	12.63	11.86	9.94	8.95	8.26	7.72	7.33	6.93	6.71	6.12 / 9.96	
JHF-32	12.91	12.17	10.22	9.11	8.39	7.81	7.40	6.99	6.76	6.18 / 10.29	
JHF-33	12.60	11.82	9.99	8.92	8.29	7.75	7.38	6.98	6.75	6.09 / 10.01	
JHF-34	12.62	11.89	10.00	8.98	8.34	7.79	7.42	7.02	6.80	6.10 / 10.20	
JHF-35	11.41	10.69	9.16	8.38	7.93	7.53	7.25	6.93	6.73	5.70 / 9.64	
JHF-36	11.25	10.54	9.04	8.29	7.86	7.48	7.22	6.90	6.71	5.67 / 9.57	
JHF-37	11.29	10.57	9.05	8.29	7.86	7.49	7.23	6.91	6.72	5.68 / 9.63	
GHLC-1	12.23	11.67	10.82	9.40	8.09	6.96	6.13	5.19	4.80	5.59 / 10.12	
GHLC-2	12.34	11.76	10.84	9.41	8.03	6.92	6.12	5.24	4.85	5.79 / 9.95	
GHLC-3	12.36	11.76	10.78	9.34	8.00	6.87	6.12	5.27	4.90	5.88 / 9.76	
GHLC-4	12.45	11.80	10.78	9.31	7.97	6.87	6.15	5.34	4.99	6.18 / 9.95	
GHLC-5	12.37	11.84	10.86	9.34	7.96	6.90	6.19	5.40	5.07	6.27 / 9.94	
GHLC-6	12.49	11.95	10.88	9.34	7.97	6.92	6.23	5.45	5.13	6.47 / 9.74	
GHLC-7	12.49	11.90	10.80	9.25	7.90	6.88	6.20	5.44	5.11	6.45 / 9.40	
GHLC-8	12.46	11.90	10.79	9.23	7.90	6.89	6.23	5.48	5.17	6.47 / 9.43	
GHLC-9	12.33	11.79	10.59	9.03	7.74	6.79	6.17	5.45	5.16	6.32 / 9.26	
GHLC-10	12.22	11.68	10.48	8.90	7.64	6.73	6.13	5.45	5.18	6.17 / 9.16	
GHLC-11	12.07	11.52	10.19	8.70	7.49	6.67	6.11	5.46	5.22	5.60 / 9.35	
GHLC-12	11.89	11.39	10.04	8.53	7.35	6.61	6.09	5.50	5.26	5.60 / 8.87	
GHLC-13	11.98	11.49	10.09	8.60	7.40	6.63	6.09	5.50	5.27	5.82 / 8.89	
GHLC-14	12.02	11.51	10.17	8.64	7.46	6.68	6.12	5.50	5.26	5.49 / 8.82	

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-15	12.00	11.49	10.12	8.61	7.43	6.66	6.12	5.50	5.26	5.55 /	8.85
GHLC-16	11.99	11.46	10.08	8.59	7.41	6.65	6.12	5.51	5.28	5.63 /	8.77
GHLC-17	12.05	11.49	10.12	8.58	7.45	6.69	6.15	5.55	5.32	5.67 /	8.81
GHLC-18	11.98	11.49	10.02	8.56	7.46	6.69	6.16	5.56	5.33	5.67 /	8.72
GHLC-19	11.95	11.38	9.88	8.48	7.41	6.65	6.13	5.55	5.31	5.49 /	8.66
GHLC-20	11.99	11.46	9.97	8.51	7.49	6.74	6.21	5.61	5.38	5.40 /	8.79
GHLC-21	12.08	11.47	9.96	8.55	7.52	6.77	6.24	5.67	5.42	5.55 /	8.88
GHLC-22	12.15	11.60	10.11	8.59	7.57	6.79	6.25	5.66	5.42	5.68 /	9.11
GHLC-23	12.29	11.66	10.07	8.68	7.61	6.84	6.29	5.70	5.45	5.70 /	9.14
GHLC-24	12.21	11.63	10.03	8.64	7.62	6.88	6.32	5.73	5.48	5.64 /	9.23
GHLC-25	12.07	11.46	9.89	8.52	7.54	6.84	6.30	5.72	5.47	5.51 /	9.22
GHLC-26	11.83	11.27	9.73	8.33	7.41	6.73	6.21	5.68	5.44	5.39 /	8.83
GHLC-27	11.17	10.58	9.11	8.03	7.25	6.63	6.15	5.68	5.46	5.16 /	8.97
GHLC-28	11.81	11.21	9.58	8.30	7.40	6.73	6.22	5.69	5.45	5.41 /	9.01
GHLC-29	11.04	10.48	9.03	8.02	7.22	6.59	6.14	5.68	5.46	5.18 /	8.97
GHLC-30	10.94	10.30	8.99	8.00	7.20	6.57	6.12	5.67	5.45	5.26 /	9.02
GHLC-31	10.75	10.12	8.81	7.81	7.09	6.50	6.07	5.64	5.42	4.98 /	8.81
GHLC-32	10.56	9.92	8.66	7.73	7.03	6.47	6.07	5.65	5.45	4.92 /	8.70
GHLC-33	10.87	10.27	8.86	7.87	7.15	6.55	6.10	5.66	5.45	5.10 /	8.85
GHLC-34	10.61	10.02	8.69	7.75	7.05	6.46	6.06	5.65	5.45	5.01 /	8.63
GHLC-35	10.73	10.15	8.77	7.84	7.09	6.48	6.08	5.66	5.45	5.08 /	8.65
GHLC-36	11.22	10.60	9.11	8.10	7.27	6.61	6.15	5.69	5.47	5.27 /	8.86
GHLC-37	11.09	10.48	8.98	7.94	7.20	6.56	6.11	5.66	5.44	5.10 /	8.76
GHLC-38	11.52	10.81	9.26	8.17	7.34	6.67	6.18	5.70	5.47	5.31 /	8.92
GHLC-39	11.29	10.66	9.14	8.05	7.26	6.61	6.14	5.67	5.45	5.27 /	8.81
GHLC-40	11.86	11.17	9.56	8.33	7.46	6.76	6.23	5.72	5.48	5.65 /	9.10
GHLC-41	11.39	10.74	9.22	8.14	7.30	6.66	6.17	5.70	5.47	5.35 /	8.82
GHLC-42	11.82	11.12	9.53	8.34	7.46	6.76	6.23	5.72	5.48	5.71 /	9.04
GHLC-43	12.29	11.58	9.82	8.58	7.62	6.88	6.31	5.76	5.50	6.00 /	9.22
GHLC-44	12.97	12.14	10.39	8.98	7.92	7.08	6.45	5.81	5.54	6.38 /	9.54
GHLC-45	12.76	11.97	10.12	8.77	7.78	6.98	6.38	5.78	5.51	6.22 /	9.33
GHLC-46	12.87	12.05	10.23	8.85	7.83	7.04	6.41	5.79	5.52	6.25 /	9.34
GHLC-47	12.96	12.10	10.31	8.90	7.84	7.05	6.45	5.81	5.53	6.23 /	9.28
GHLC-48	12.23	11.47	9.72	8.42	7.52	6.84	6.31	5.75	5.49	5.66 /	8.88
GHLC-49	12.26	11.53	9.73	8.47	7.52	6.83	6.29	5.74	5.48	5.71 /	8.83
GHLC-50	12.95	12.13	10.27	8.88	7.82	7.02	6.44	5.80	5.52	6.19 /	9.18
GHLC-51	12.56	11.75	9.87	8.54	7.61	6.88	6.33	5.76	5.50	5.94 /	8.87
GHLC-52	12.16	11.40	9.60	8.38	7.47	6.79	6.25	5.73	5.48	5.68 /	8.68
GHLC-53	12.40	11.65	9.80	8.50	7.58	6.87	6.31	5.76	5.50	5.92 /	8.79
JHF-S1	12.22	11.66	10.50	9.23	7.99	6.98	6.28	5.47	5.14	6.35 /	9.44
JHF-S2	12.18	11.65	10.47	9.18	7.95	6.95	6.26	5.46	5.13	6.34 /	9.25
JHF-S3	12.18	11.60	10.48	9.17	7.96	6.96	6.26	5.45	5.12	6.35 /	9.15
JHF-S4	12.03	11.52	10.27	8.92	7.73	6.82	6.20	5.48	5.20	6.04 /	8.99
JHF-S5	11.89	11.38	10.09	8.66	7.54	6.70	6.14	5.47	5.21	5.81 /	8.81
JHF-S6	11.96	11.43	10.12	8.72	7.60	6.75	6.16	5.49	5.23	5.86 /	8.78
JHF-S7	11.95	11.39	10.08	8.73	7.57	6.73	6.15	5.48	5.22	5.84 /	8.73
JHF-S8	11.54	11.04	9.67	8.26	7.26	6.57	6.08	5.53	5.31	5.47 /	8.29
JHF-S9	11.54	11.03	9.68	8.26	7.25	6.57	6.08	5.53	5.31	5.48 /	8.30
JHF-S10	11.44	10.92	9.44	8.14	7.25	6.62	6.15	5.65	5.43	5.35 /	8.38
JHF-S11	11.92	11.31	9.73	8.33	7.44	6.76	6.24	5.70	5.46	5.70 /	8.91
JHF-S12	12.12	11.48	9.86	8.44	7.53	6.82	6.29	5.74	5.49	5.83 /	8.99
JHF-S13	7.65	7.47	6.83	6.13	5.46	4.93	4.54	4.04	3.78	2.84 /	8.49
JHF-S14	7.59	7.42	6.82	6.04	5.43	4.89	4.50	4.01	3.75	2.83 /	8.32
JHF-S15	7.64	7.44	6.84	6.08	5.44	4.91	4.51	4.02	3.76	2.82 /	8.28
JHF-S16	8.13	7.92	7.22	6.48	5.76	5.17	4.73	4.16	3.91	3.17 /	8.29

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-S17	8.10	7.89	7.22	6.43	5.75	5.15	4.72	4.14	3.90	3.12 / 8.16
JHF-S18	8.09	7.86	7.25	6.49	5.76	5.15	4.71	4.14	3.91	3.12 / 8.07
GHLC-S1	11.97	11.41	10.36	9.12	7.96	6.95	6.17	5.27	4.89	6.83 / 10.12
GHLC-S2	11.93	11.31	10.27	9.07	7.90	6.92	6.14	5.26	4.89	6.82 / 10.14
GHLC-S3	11.94	11.35	10.33	9.08	7.94	6.93	6.16	5.29	4.92	6.88 / 10.10
GHLC-S4	12.11	11.51	10.49	9.16	7.98	6.95	6.21	5.37	5.00	6.68 / 10.12
GHLC-S5	12.08	11.47	10.42	9.13	7.95	6.93	6.20	5.35	4.99	6.64 / 9.99
GHLC-S6	12.20	11.67	10.57	9.26	8.05	7.02	6.28	5.43	5.07	6.55 / 9.73
GHLC-S7	12.17	11.64	10.52	9.25	8.04	7.00	6.27	5.43	5.07	6.60 / 9.72
GHLC-S8	12.17	11.66	10.55	9.29	8.05	7.00	6.27	5.43	5.07	6.56 / 9.69
GHLC-S9	12.19	11.63	10.56	9.26	8.03	7.00	6.27	5.43	5.07	6.56 / 9.65
GHLC-S10	12.17	11.58	10.54	9.24	8.03	7.00	6.26	5.42	5.06	6.53 / 9.59

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。