

PSJ 予測統計値
(平均値)

2010年 10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	13.28	12.52	11.44	10.22	9.16	8.26	7.60	6.82	6.49	7.30 / 11.78		
JHF-2	13.33	12.50	11.45	10.17	9.14	8.25	7.58	6.82	6.49	7.26 / 11.74		
JHF-3	13.39	12.66	11.50	10.30	9.20	8.30	7.62	6.84	6.51	7.54 / 11.89		
JHF-4	13.58	12.81	11.67	10.36	9.26	8.34	7.65	6.85	6.51	7.90 / 11.82		
JHF-5	13.97	13.12	11.92	10.62	9.43	8.47	7.77	6.90	6.55	8.11 / 12.28		
JHF-6	13.76	12.89	11.72	10.41	9.28	8.37	7.70	6.87	6.53	7.77 / 12.09		
JHF-7	13.00	12.24	11.15	9.96	8.94	8.12	7.51	6.79	6.49	6.72 / 11.55		
JHF-8	13.71	12.85	11.64	10.33	9.24	8.34	7.65	6.87	6.54	7.60 / 12.05		
JHF-9	13.20	12.43	11.22	9.95	8.98	8.16	7.55	6.83	6.52	6.85 / 11.63		
JHF-10	12.71	11.96	10.86	9.70	8.78	8.02	7.43	6.78	6.49	6.38 / 11.31		
JHF-11	13.15	12.44	11.26	10.01	9.01	8.18	7.55	6.85	6.54	6.80 / 11.84		
JHF-12	13.06	12.33	11.14	9.92	8.92	8.12	7.50	6.82	6.51	6.72 / 11.68		
JHF-13	12.92	12.18	11.04	9.84	8.87	8.09	7.48	6.82	6.52	6.56 / 11.76		
JHF-14	12.65	11.96	10.78	9.67	8.75	8.00	7.40	6.79	6.51	6.49 / 11.39		
JHF-15	13.78	12.98	11.69	10.40	9.28	8.39	7.68	6.91	6.59	7.83 / 12.50		
JHF-16	14.33	13.46	12.19	10.78	9.56	8.59	7.84	6.97	6.62	8.15 / 12.90		
JHF-17	13.91	13.08	11.82	10.46	9.34	8.45	7.78	6.97	6.63	7.78 / 12.65		
JHF-18	13.65	12.85	11.57	10.22	9.19	8.33	7.67	6.92	6.59	7.78 / 12.30		
JHF-19	12.92	12.15	10.92	9.79	8.84	8.09	7.48	6.84	6.56	6.89 / 11.53		
JHF-20	13.04	12.28	11.06	9.82	8.90	8.14	7.53	6.87	6.58	7.12 / 11.68		
JHF-21	13.45	12.66	11.35	10.10	9.07	8.26	7.61	6.91	6.61	7.58 / 12.06		
JHF-22	13.50	12.66	11.41	10.08	9.08	8.26	7.61	6.92	6.62	7.65 / 12.21		
JHF-23	14.14	13.23	11.87	10.46	9.36	8.45	7.75	6.98	6.66	7.77 / 12.76		
JHF-24	13.89	13.00	11.66	10.29	9.23	8.38	7.70	6.96	6.65	7.71 / 12.59		
JHF-25	13.88	13.00	11.58	10.24	9.20	8.35	7.68	6.96	6.66	7.70 / 12.44		
JHF-26	14.30	13.41	12.00	10.50	9.37	8.47	7.77	6.99	6.67	8.15 / 12.54		
JHF-27	13.91	13.06	11.66	10.27	9.21	8.38	7.71	6.99	6.67	7.66 / 12.33		
JHF-28	13.25	12.42	11.11	9.84	8.91	8.15	7.56	6.92	6.64	6.87 / 11.71		
JHF-29	13.05	12.25	10.89	9.71	8.83	8.11	7.52	6.93	6.66	6.63 / 11.47		
JHF-30	12.73	11.99	10.74	9.59	8.73	8.05	7.48	6.92	6.65	6.54 / 11.16		
JHF-31	12.68	11.97	10.67	9.57	8.69	8.01	7.46	6.93	6.66	6.43 / 10.96		
JHF-32	12.91	12.18	10.86	9.69	8.85	8.13	7.55	6.99	6.71	6.53 / 11.34		
JHF-33	12.73	11.99	10.74	9.60	8.73	8.05	7.50	6.98	6.71	6.42 / 11.03		
JHF-34	12.83	12.09	10.84	9.63	8.80	8.10	7.55	7.02	6.75	6.43 / 11.24		
JHF-35	11.66	10.97	9.87	8.92	8.26	7.70	7.28	6.87	6.63	6.02 / 9.91		
JHF-36	11.45	10.77	9.66	8.76	8.14	7.63	7.25	6.86	6.63	5.98 / 9.73		
JHF-37	11.46	10.85	9.64	8.77	8.16	7.64	7.26	6.87	6.64	6.02 / 9.71		
JHF-38	11.37	10.70	9.61	8.70	8.13	7.64	7.26	6.88	6.65	5.95 / 9.74		
JHF-39	11.06	10.38	9.35	8.55	8.02	7.57	7.23	6.87	6.65	5.76 / 9.36		
JHF-40	10.72	10.05	9.09	8.38	7.89	7.51	7.22	6.86	6.64	5.60 / 9.16		
JHF-41	10.49	9.86	8.95	8.28	7.82	7.42	7.15	6.82	6.62	5.47 / 9.16		
GHLC-1	12.20	11.62	11.09	10.12	8.84	7.57	6.58	5.37	4.82	4.89 / 11.15		
GHLC-2	12.26	11.66	11.06	10.02	8.74	7.49	6.53	5.41	4.89	5.33 / 10.81		
GHLC-3	12.31	11.74	11.08	10.07	8.73	7.47	6.52	5.46	4.95	5.60 / 10.89		
GHLC-4	12.43	11.85	11.24	10.15	8.77	7.51	6.59	5.53	5.04	5.87 / 10.79		
GHLC-5	12.44	11.88	11.34	10.21	8.84	7.55	6.65	5.60	5.13	5.84 / 10.73		
GHLC-6	12.57	11.99	11.34	10.18	8.83	7.57	6.68	5.66	5.20	6.17 / 10.46		
GHLC-7	12.45	11.87	11.25	10.12	8.72	7.50	6.63	5.63	5.18	6.08 / 10.43		
GHLC-8	12.58	12.01	11.32	10.14	8.75	7.51	6.65	5.66	5.22	6.26 / 10.41		
GHLC-9	12.33	11.78	11.15	9.96	8.53	7.34	6.54	5.62	5.21	6.26 / 10.44		
GHLC-10	12.26	11.71	11.02	9.74	8.38	7.25	6.49	5.61	5.22	6.41 / 10.27		

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-11	12.11	11.63	10.86	9.59	8.22	7.15	6.45	5.62	5.26	6.60 / 9.99	
GHLC-12	11.95	11.41	10.65	9.40	8.04	7.06	6.39	5.61	5.29	6.43 / 9.60	
GHLC-13	12.01	11.48	10.76	9.43	8.09	7.11	6.40	5.62	5.30	6.25 / 10.36	
GHLC-14	11.97	11.41	10.70	9.46	8.13	7.13	6.43	5.62	5.29	6.57 / 10.10	
GHLC-15	12.22	11.63	10.88	9.60	8.19	7.16	6.45	5.64	5.30	6.51 / 10.63	
GHLC-16	12.29	11.80	10.98	9.61	8.23	7.18	6.46	5.66	5.33	6.23 / 11.46	
GHLC-17	12.21	11.73	10.95	9.62	8.19	7.16	6.46	5.66	5.34	6.25 / 10.83	
GHLC-18	12.16	11.67	10.86	9.52	8.15	7.15	6.46	5.67	5.35	6.69 / 10.43	
GHLC-19	11.95	11.44	10.65	9.34	8.02	7.08	6.41	5.64	5.34	6.63 / 9.68	
GHLC-20	12.08	11.56	10.67	9.39	8.06	7.19	6.49	5.71	5.40	6.43 / 9.82	
GHLC-21	12.17	11.66	10.80	9.44	8.11	7.21	6.52	5.75	5.45	6.54 / 9.93	
GHLC-22	12.28	11.77	10.91	9.55	8.18	7.25	6.54	5.76	5.44	6.70 / 10.29	
GHLC-23	12.48	11.94	11.04	9.62	8.27	7.31	6.58	5.78	5.47	6.55 / 10.93	
GHLC-24	12.44	11.86	10.95	9.54	8.23	7.31	6.61	5.82	5.51	6.44 / 10.38	
GHLC-25	12.29	11.75	10.82	9.41	8.16	7.26	6.61	5.83	5.52	6.31 / 10.36	
GHLC-26	12.15	11.61	10.70	9.31	8.07	7.15	6.50	5.77	5.48	6.21 / 10.93	
GHLC-27	11.48	10.92	9.96	8.82	7.84	7.03	6.43	5.78	5.51	5.69 / 10.39	
GHLC-28	11.94	11.38	10.40	9.06	7.96	7.13	6.50	5.80	5.51	6.06 / 9.75	
GHLC-29	11.21	10.66	9.70	8.65	7.71	6.97	6.38	5.77	5.50	5.54 / 9.64	
GHLC-30	11.01	10.50	9.58	8.60	7.66	6.93	6.34	5.75	5.50	5.59 / 9.69	
GHLC-31	10.88	10.34	9.42	8.45	7.55	6.86	6.30	5.74	5.48	5.39 / 9.48	
GHLC-32	10.78	10.23	9.35	8.33	7.49	6.82	6.28	5.75	5.50	5.27 / 9.36	
GHLC-33	10.99	10.44	9.48	8.46	7.61	6.90	6.34	5.76	5.51	5.54 / 9.56	
GHLC-34	10.81	10.29	9.33	8.34	7.51	6.82	6.28	5.75	5.51	5.39 / 9.43	
GHLC-35	10.72	10.20	9.27	8.31	7.48	6.81	6.27	5.74	5.50	5.34 / 9.46	
GHLC-36	11.01	10.42	9.44	8.45	7.64	6.92	6.35	5.77	5.52	5.70 / 9.62	
GHLC-37	10.90	10.32	9.42	8.41	7.57	6.87	6.31	5.75	5.50	5.57 / 9.55	
GHLC-38	11.24	10.70	9.65	8.61	7.75	7.01	6.42	5.80	5.53	5.95 / 9.75	
GHLC-39	11.07	10.50	9.53	8.46	7.65	6.94	6.36	5.77	5.51	5.74 / 9.59	
GHLC-40	11.56	10.92	9.89	8.81	7.88	7.10	6.48	5.82	5.55	6.39 / 9.96	
GHLC-41	11.11	10.49	9.55	8.48	7.68	6.97	6.40	5.78	5.53	5.85 / 9.65	
GHLC-42	11.83	11.19	10.20	9.13	8.14	7.23	6.56	5.82	5.52	6.45 / 10.84	
GHLC-43	12.31	11.63	10.59	9.41	8.35	7.38	6.65	5.87	5.54	6.99 / 11.13	
GHLC-44	12.86	12.17	11.10	9.83	8.62	7.60	6.81	5.94	5.58	7.26 / 10.65	
GHLC-45	12.67	11.93	10.90	9.65	8.48	7.49	6.74	5.89	5.55	7.10 / 10.84	
GHLC-46	12.76	12.08	10.99	9.68	8.53	7.53	6.78	5.91	5.55	7.18 / 10.74	
GHLC-47	12.80	12.05	10.97	9.70	8.49	7.51	6.79	5.91	5.56	7.21 / 10.36	
GHLC-48	12.17	11.51	10.43	9.19	8.16	7.26	6.62	5.85	5.52	6.46 / 10.17	
GHLC-49	12.24	11.52	10.42	9.21	8.15	7.26	6.62	5.85	5.53	6.66 / 9.95	
GHLC-50	12.81	12.07	10.93	9.62	8.46	7.49	6.78	5.91	5.56	7.16 / 10.49	
GHLC-51	12.46	11.72	10.58	9.30	8.23	7.31	6.66	5.87	5.54	6.81 / 10.07	
GHLC-52	12.06	11.37	10.27	9.10	8.06	7.19	6.56	5.83	5.52	6.53 / 9.74	
GHLC-53	12.28	11.58	10.46	9.19	8.15	7.27	6.62	5.86	5.54	6.75 / 10.05	
JHF-S1	12.13	11.52	10.82	9.75	8.61	7.51	6.66	5.63	5.16	7.13 / 10.32	
JHF-S2	12.08	11.50	10.85	9.76	8.60	7.49	6.64	5.63	5.15	7.18 / 10.19	
JHF-S3	11.86	11.28	10.57	9.60	8.50	7.42	6.59	5.58	5.11	6.71 / 10.29	
JHF-S4	11.71	11.15	10.42	9.42	8.26	7.21	6.46	5.56	5.17	6.70 / 10.06	
JHF-S5	11.55	11.01	10.33	9.23	8.09	7.08	6.39	5.54	5.18	6.71 / 9.88	
JHF-S6	11.65	11.10	10.38	9.30	8.16	7.13	6.43	5.58	5.20	6.87 / 9.90	
JHF-S7	11.60	11.09	10.31	9.29	8.13	7.11	6.40	5.56	5.20	6.84 / 9.83	
JHF-S8	11.27	10.79	10.00	8.89	7.74	6.88	6.27	5.56	5.26	6.36 / 9.30	
JHF-S9	11.55	11.07	10.29	9.18	7.95	7.04	6.38	5.63	5.31	6.37 / 10.00	
JHF-S10	11.50	11.02	10.18	9.03	7.93	7.06	6.43	5.72	5.43	6.06 / 10.21	
JHF-S11	11.95	11.39	10.50	9.28	8.16	7.24	6.55	5.80	5.49	6.45 / 10.30	
JHF-S12	12.15	11.59	10.61	9.37	8.25	7.31	6.62	5.84	5.53	6.61 / 10.17	

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-S13	7.90	7.70	7.36	6.72	5.96	5.26	4.74	4.14	3.80	3.03 / 10.19
JHF-S14	7.88	7.69	7.35	6.69	5.96	5.28	4.77	4.16	3.81	3.00 / 10.10
JHF-S15	7.93	7.71	7.40	6.71	5.97	5.30	4.77	4.16	3.83	2.99 / 10.10
JHF-S16	8.36	8.17	7.78	7.11	6.30	5.57	5.01	4.29	3.96	3.41 / 10.04
JHF-S17	8.29	8.12	7.71	7.02	6.26	5.52	4.95	4.24	3.92	3.34 / 10.02
JHF-S18	8.37	8.11	7.74	7.09	6.29	5.55	4.97	4.25	3.94	3.32 / 10.03
GHLC-S1	11.89	11.27	10.66	9.66	8.57	7.44	6.55	5.41	4.87	6.51 / 10.82
GHLC-S2	11.80	11.16	10.52	9.57	8.47	7.37	6.51	5.40	4.87	6.59 / 10.93
GHLC-S3	11.85	11.22	10.63	9.66	8.52	7.43	6.52	5.43	4.90	6.57 / 10.88
GHLC-S4	11.98	11.40	10.76	9.73	8.60	7.47	6.59	5.52	5.01	6.68 / 10.89
GHLC-S5	11.93	11.36	10.72	9.71	8.56	7.45	6.56	5.51	5.00	6.77 / 10.84
GHLC-S6	12.09	11.50	10.85	9.83	8.70	7.56	6.66	5.58	5.07	6.89 / 10.61
GHLC-S7	12.05	11.50	10.87	9.79	8.67	7.54	6.66	5.59	5.07	6.90 / 10.47
GHLC-S8	12.07	11.47	10.78	9.80	8.64	7.53	6.64	5.58	5.07	6.99 / 10.45
GHLC-S9	12.02	11.46	10.79	9.78	8.62	7.52	6.63	5.57	5.08	6.99 / 10.42
GHLC-S10	11.98	11.43	10.75	9.74	8.60	7.52	6.64	5.58	5.08	7.01 / 10.42

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。