

PSJ 予測統計値
(中央値)

2010年 12月 1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	13.20	13.20	11.13	9.79	8.85	7.90	7.37	7.09	6.74	6.62 / 10.80	
JHF-2	13.12	13.12	11.03	9.43	8.86	7.91	7.40	7.08	6.74	6.53 / 10.74	
JHF-3	13.29	13.29	11.14	9.52	8.94	7.94	7.40	7.09	6.74	6.71 / 10.89	
JHF-4	13.53	13.53	11.29	9.75	8.97	8.01	7.40	7.09	6.74	7.01 / 10.81	
JHF-5	13.98	13.90	11.66	9.73	9.07	8.08	7.55	7.10	6.76	7.24 / 11.23	
JHF-6	13.70	13.61	11.38	9.89	9.01	8.05	7.50	7.10	6.74	6.90 / 11.01	
JHF-7	13.36	12.67	10.52	9.48	8.63	7.92	7.46	6.98	6.74	6.21 / 10.55	
JHF-8	13.54	13.42	11.16	9.97	9.02	8.06	7.53	7.03	6.74	6.70 / 11.02	
JHF-9	13.59	12.87	10.62	9.68	8.74	7.94	7.44	6.94	6.78	6.22 / 10.65	
JHF-10	12.79	12.29	10.15	9.39	8.46	7.88	7.39	6.94	6.74	5.90 / 10.35	
JHF-11	12.84	12.77	10.59	9.66	8.77	7.93	7.52	6.97	6.78	6.20 / 10.82	
JHF-12	12.70	12.61	10.44	9.52	8.65	7.93	7.47	6.97	6.78	6.19 / 10.68	
JHF-13	12.61	12.51	10.32	9.48	8.59	7.88	7.48	6.93	6.78	6.12 / 10.74	
JHF-14	12.48	12.15	10.07	9.24	8.46	7.81	7.43	6.92	6.74	5.99 / 10.40	
JHF-15	13.91	13.28	11.09	9.92	9.08	8.11	7.60	7.00	6.78	7.04 / 11.38	
JHF-16	14.51	13.86	11.39	10.18	9.27	8.25	7.61	7.04	6.82	7.81 / 11.72	
JHF-17	14.09	13.33	11.00	9.92	9.03	8.24	7.64	7.02	6.86	7.11 / 11.53	
JHF-18	13.81	13.10	10.72	9.74	8.84	8.12	7.57	6.99	6.86	7.10 / 11.19	
JHF-19	12.78	12.70	10.19	9.39	8.54	7.84	7.41	6.98	6.75	6.38 / 10.48	
JHF-20	13.71	12.71	10.25	9.46	8.61	7.88	7.45	7.02	6.78	6.46 / 10.64	
JHF-21	13.80	12.99	10.37	9.58	8.70	7.95	7.48	7.05	6.81	6.79 / 11.00	
JHF-22	13.54	13.01	10.37	9.59	8.67	7.90	7.44	7.02	6.81	6.84 / 11.10	
JHF-23	14.15	13.50	10.71	9.84	8.89	8.09	7.56	7.05	6.87	7.37 / 11.58	
JHF-24	13.93	13.42	10.51	9.67	8.73	7.97	7.47	7.09	6.84	6.96 / 11.43	
JHF-25	13.93	13.00	10.47	9.66	8.77	7.93	7.47	7.09	6.81	6.87 / 11.31	
JHF-26	14.02	13.43	10.74	9.83	8.85	8.02	7.48	6.98	6.82	7.45 / 11.38	
JHF-27	13.96	13.31	10.55	9.66	8.77	8.01	7.45	7.02	6.84	6.87 / 11.19	
JHF-28	13.53	12.61	10.12	9.29	8.46	7.90	7.33	6.92	6.72	6.34 / 10.64	
JHF-29	13.44	12.67	10.03	9.23	8.34	7.91	7.56	7.16	6.71	6.24 / 10.42	
JHF-30	13.19	12.45	9.78	9.09	8.23	7.90	7.60	7.12	6.70	6.18 / 10.16	
JHF-31	12.62	12.10	9.78	8.98	8.18	7.90	7.60	7.07	6.71	6.03 / 9.99	
JHF-32	13.10	12.53	9.79	9.11	8.29	7.95	7.60	7.17	6.73	6.10 / 10.32	
JHF-33	12.64	11.99	9.80	8.97	8.22	7.94	7.64	7.10	6.76	6.02 / 10.04	
JHF-34	12.73	12.04	9.85	8.97	8.29	7.99	7.64	7.14	6.79	6.03 / 10.22	
JHF-35	11.74	10.21	8.79	8.26	8.00	7.56	7.17	6.84	6.64	5.65 / 9.24	
JHF-36	11.55	9.89	8.65	8.19	8.01	7.51	7.17	6.81	6.70	5.61 / 9.16	
JHF-37	11.54	9.95	8.66	8.20	8.01	7.51	7.19	6.81	6.67	5.65 / 9.18	
JHF-38	11.25	9.65	8.52	8.14	7.98	7.45	7.18	6.77	6.66	5.65 / 9.10	
JHF-39	10.82	9.41	8.36	8.16	7.99	7.36	7.12	6.72	6.71	5.47 / 8.99	
JHF-40	10.56	9.18	8.32	8.14	7.96	7.83	7.09	6.76	6.76	5.33 / 8.86	
JHF-41	10.33	9.01	8.27	8.10	7.94	7.35	7.00	6.76	6.76	5.24 / 8.77	
JHF-42	9.80	8.87	8.23	8.13	7.72	7.33	6.94	6.83	6.83	5.12 / 8.68	
JHF-43	10.08	8.86	8.30	8.04	7.81	7.32	6.98	6.82	6.82	5.15 / 8.72	
GHLC-1	12.45	12.45	10.70	9.40	8.04	6.82	5.69	5.14	4.59	4.67 / 10.62	
GHLC-2	12.36	12.36	11.41	9.38	7.85	6.80	6.12	5.23	4.75	5.14 / 10.48	
GHLC-3	12.50	12.50	11.44	9.45	7.56	6.69	5.99	5.32	4.85	5.45 / 10.27	
GHLC-4	12.34	12.34	11.46	9.52	8.03	6.67	6.09	5.38	4.94	5.80 / 10.40	
GHLC-5	12.45	12.45	11.49	9.59	8.00	6.68	6.12	5.33	5.02	5.73 / 10.41	
GHLC-6	12.46	12.46	11.26	9.68	8.18	6.82	6.28	5.48	5.05	6.08 / 10.16	
GHLC-7	12.57	12.57	11.38	9.79	8.16	6.77	6.13	5.36	5.05	6.00 / 9.82	
GHLC-8	12.55	12.55	10.90	9.21	8.20	6.82	6.21	5.46	5.08	6.20 / 9.86	

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-9	12.46	12.46	10.66	8.91	7.73	6.73	6.14	5.38	5.07	6.16 / 9.65	
GHLC-10	12.29	12.29	10.42	8.66	7.49	6.67	6.14	5.43	5.12	6.27 / 9.55	
GHLC-11	11.91	11.91	10.05	8.60	7.43	6.77	6.25	5.46	5.18	6.03 / 9.69	
GHLC-12	11.58	11.58	9.70	8.41	7.27	6.71	6.19	5.42	5.30	5.84 / 9.18	
GHLC-13	11.75	11.75	9.86	8.50	7.35	6.69	6.18	5.47	5.22	5.73 / 9.17	
GHLC-14	11.88	11.88	9.95	8.61	7.43	6.76	6.28	5.48	5.26	5.87 / 9.13	
GHLC-15	11.75	11.75	9.85	8.56	7.35	6.79	6.25	5.45	5.34	5.89 / 9.13	
GHLC-16	11.83	11.83	9.81	8.53	7.35	6.73	6.23	5.45	5.34	5.77 / 9.06	
GHLC-17	11.70	11.70	9.79	8.57	7.36	6.76	6.23	5.49	5.34	5.84 / 9.09	
GHLC-18	11.72	11.72	9.72	8.54	7.33	6.78	6.22	5.52	5.41	5.96 / 8.96	
GHLC-19	11.59	11.59	9.65	8.51	7.37	6.76	6.20	5.53	5.44	5.80 / 8.94	
GHLC-20	11.54	11.54	9.76	8.56	7.52	6.75	6.29	5.63	5.46	5.69 / 9.05	
GHLC-21	11.53	11.53	9.68	8.50	7.38	6.81	6.32	5.69	5.49	5.82 / 8.94	
GHLC-22	11.89	11.40	9.75	8.49	7.41	6.87	6.27	5.68	5.49	5.96 / 8.98	
GHLC-23	11.83	11.83	9.75	8.57	7.41	6.87	6.33	5.74	5.55	5.96 / 8.95	
GHLC-24	11.78	11.77	9.81	8.55	7.48	6.85	6.37	5.78	5.55	5.90 / 9.02	
GHLC-25	11.52	11.52	9.65	8.07	7.47	6.90	6.39	5.83	5.55	5.72 / 9.08	
GHLC-26	11.08	11.08	9.32	8.34	7.34	6.74	6.33	5.77	5.43	5.59 / 8.68	
GHLC-27	10.11	10.11	8.98	7.87	7.26	6.63	6.26	5.91	5.43	5.28 / 8.93	
GHLC-28	11.01	11.01	9.27	7.94	7.36	6.78	6.34	5.86	5.42	5.59 / 8.95	
GHLC-29	10.13	10.01	8.87	7.88	7.24	6.58	6.26	5.91	5.48	5.29 / 8.97	
GHLC-30	10.26	9.90	8.40	7.87	7.26	6.61	6.19	5.88	5.50	5.31 / 9.04	
GHLC-31	9.98	9.75	8.32	7.69	7.09	6.55	6.24	5.78	5.44	5.08 / 8.86	
GHLC-32	9.69	9.63	8.19	7.60	7.00	6.66	6.27	5.77	5.45	5.01 / 8.77	
GHLC-33	10.26	9.94	8.59	7.82	7.21	6.61	6.31	5.81	5.42	5.20 / 8.92	
GHLC-34	10.05	9.88	8.29	7.74	7.13	6.63	6.29	5.77	5.44	5.11 / 8.80	
GHLC-35	10.29	9.90	8.31	7.78	7.22	6.63	6.30	5.77	5.40	5.18 / 8.85	
GHLC-36	11.07	10.37	8.73	8.02	7.41	6.65	6.32	5.86	5.50	5.43 / 9.12	
GHLC-37	10.94	10.21	8.55	7.98	7.41	6.63	6.33	5.86	5.47	5.23 / 8.90	
GHLC-38	11.55	10.44	8.79	8.01	7.41	6.82	6.30	5.86	5.47	5.49 / 9.07	
GHLC-39	11.37	10.28	8.49	7.95	7.45	6.80	6.31	5.83	5.51	5.30 / 8.94	
GHLC-40	11.88	10.97	9.17	8.11	7.48	6.94	6.38	5.91	5.50	5.83 / 9.23	
GHLC-41	11.42	10.34	8.77	8.00	7.48	6.84	6.33	5.85	5.54	5.50 / 8.99	
GHLC-42	11.89	11.08	9.19	8.18	7.45	6.94	6.35	5.92	5.58	5.91 / 9.22	
GHLC-43	11.83	11.01	9.62	8.35	7.57	7.04	6.41	5.98	5.60	6.21 / 9.44	
GHLC-44	12.78	11.33	10.09	8.68	7.79	7.20	6.51	6.05	5.64	6.52 / 9.75	
GHLC-45	12.33	11.41	9.92	8.52	7.77	7.20	6.45	6.01	5.60	6.34 / 9.57	
GHLC-46	12.51	11.73	9.95	8.58	7.87	7.30	6.52	5.97	5.61	6.37 / 9.57	
GHLC-47	12.53	11.88	10.00	8.61	7.88	7.32	6.54	5.98	5.57	6.37 / 9.54	
GHLC-48	11.75	11.35	9.27	8.28	7.60	7.00	6.43	5.90	5.56	5.98 / 9.08	
GHLC-49	12.15	11.45	9.24	8.26	7.60	7.01	6.43	5.88	5.56	5.97 / 9.06	
GHLC-50	12.53	12.20	9.99	8.63	7.89	7.31	6.53	5.99	5.61	6.33 / 9.41	
GHLC-51	11.85	11.83	9.48	8.42	7.69	7.13	6.48	5.91	5.56	6.08 / 9.12	
GHLC-52	11.47	11.31	9.12	8.25	7.57	6.91	6.33	5.81	5.58	5.89 / 8.95	
GHLC-53	11.67	11.67	9.38	8.36	7.68	7.03	6.40	5.89	5.62	6.04 / 9.03	
JHF-S1	11.88	11.88	10.55	9.29	8.09	6.82	6.22	5.51	5.09	6.68 / 9.80	
JHF-S2	11.87	11.87	10.53	9.28	8.12	6.65	6.23	5.49	5.09	6.66 / 9.60	
JHF-S3	11.88	11.88	10.53	9.30	8.16	6.71	6.27	5.50	5.10	6.67 / 9.49	
JHF-S4	11.71	11.71	10.21	8.90	7.68	6.68	6.20	5.48	5.31	6.30 / 9.31	
JHF-S5	11.38	11.38	9.89	8.69	7.62	6.69	6.16	5.50	5.38	6.06 / 9.14	
JHF-S6	11.50	11.50	9.99	8.76	7.65	6.70	6.20	5.48	5.34	6.10 / 9.09	
JHF-S7	11.44	11.44	9.90	8.72	7.66	6.67	6.20	5.46	5.35	6.06 / 9.04	
JHF-S8	10.77	10.77	9.15	8.46	7.28	6.61	6.09	5.62	5.35	5.67 / 8.58	
JHF-S9	10.79	10.79	9.16	8.50	7.28	6.59	6.10	5.60	5.36	5.67 / 8.60	
JHF-S10	10.31	10.30	8.85	8.14	7.25	6.69	6.19	5.89	5.36	5.48 / 8.24	

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-S11	11.06	11.06	9.22	8.32	7.52	7.04	6.30	6.02	5.49	5.80 /	8.93
JHF-S12	11.69	10.67	9.35	8.35	7.56	7.09	6.36	6.09	5.53	5.92 /	9.16
JHF-S13	7.45	7.45	7.34	6.87	6.15	5.48	4.83	4.40	3.70	2.90 /	8.82
JHF-S14	7.50	7.50	7.37	6.85	6.20	5.50	4.83	4.33	3.75	2.87 /	8.78
JHF-S15	7.54	7.54	7.43	6.85	6.17	5.54	4.84	4.38	3.72	2.86 /	8.74
JHF-S16	7.92	7.92	7.67	7.14	6.41	5.58	5.17	4.48	3.89	3.26 /	8.77
JHF-S17	7.92	7.92	7.64	7.16	6.39	5.57	5.13	4.41	3.88	3.18 /	8.59
JHF-S18	7.94	7.94	7.62	7.18	6.42	5.59	5.16	4.34	3.89	3.17 /	8.50
GHLC-S1	11.50	11.50	10.47	9.11	7.37	6.76	6.32	5.26	4.85	6.43 /	10.44
GHLC-S2	11.50	11.50	10.41	9.05	7.36	6.65	6.30	5.30	4.82	6.51 /	10.45
GHLC-S3	11.69	11.69	10.48	9.15	7.44	6.60	6.28	5.26	4.81	6.47 /	10.39
GHLC-S4	11.80	11.80	10.47	9.00	7.76	6.59	6.22	5.34	4.93	6.63 /	10.41
GHLC-S5	11.77	11.77	10.37	9.07	7.82	6.57	6.23	5.35	4.94	6.66 /	10.37
GHLC-S6	11.88	11.88	10.73	9.27	8.04	6.98	6.26	5.36	5.05	6.82 /	10.07
GHLC-S7	11.90	11.90	10.71	9.25	8.04	6.89	6.25	5.34	5.04	6.88 /	10.09
GHLC-S8	11.88	11.88	10.67	9.23	8.10	7.07	6.28	5.35	5.05	6.88 /	10.07
GHLC-S9	11.82	11.82	10.61	9.24	8.12	6.98	6.31	5.33	5.03	6.86 /	10.05
GHLC-S10	11.76	11.76	10.56	9.19	8.13	6.82	6.31	5.35	5.06	6.84 /	10.05

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。