

PSJ 予測統計値
(中央値)

2011年 2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、バークレイズ・キャピタル、UBS、メリル Lynch 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	12.90	12.90	10.80	9.32	8.44	7.92	7.35	7.12	6.94	6.79 / 10.84		
JHF-2	12.88	12.88	11.08	9.38	8.47	7.90	7.37	7.12	6.91	6.72 / 10.77		
JHF-3	13.02	12.96	11.16	9.43	8.51	7.92	7.42	7.14	6.95	6.94 / 10.94		
JHF-4	13.15	13.06	11.27	9.50	8.59	7.94	7.40	7.14	6.94	7.23 / 10.85		
JHF-5	13.55	13.38	11.22	9.82	8.66	8.08	7.58	7.16	6.94	7.45 / 11.27		
JHF-6	13.34	13.18	11.25	9.75	8.60	8.00	7.57	7.13	6.93	7.11 / 11.10		
JHF-7	12.62	12.59	10.58	9.09	8.41	7.85	7.43	7.11	6.88	6.32 / 10.58		
JHF-8	13.30	13.12	11.15	9.60	8.65	8.01	7.52	7.13	6.91	6.97 / 11.04		
JHF-9	13.01	12.71	10.72	9.31	8.58	7.90	7.46	7.08	6.87	6.44 / 10.68		
JHF-10	12.28	12.28	10.21	9.26	8.45	7.79	7.39	7.11	6.84	5.99 / 10.38		
JHF-11	12.83	12.71	10.65	9.47	8.56	7.94	7.46	7.13	6.89	6.32 / 10.83		
JHF-12	12.87	12.56	10.51	9.50	8.53	7.86	7.46	7.11	6.90	6.33 / 10.73		
JHF-13	12.62	12.46	10.42	9.21	8.50	7.87	7.48	7.14	6.88	6.21 / 10.77		
JHF-14	12.50	12.22	10.15	9.28	8.47	7.71	7.46	7.13	6.86	6.18 / 10.43		
JHF-15	13.69	13.15	11.20	9.89	8.85	8.05	7.58	7.17	6.94	7.29 / 11.42		
JHF-16	13.94	13.55	11.53	10.10	9.00	8.18	7.63	7.19	6.97	7.78 / 11.77		
JHF-17	13.81	13.29	11.18	9.95	8.93	8.20	7.62	7.20	6.96	7.29 / 11.55		
JHF-18	13.50	13.07	11.00	9.56	8.83	8.08	7.59	7.19	6.93	7.26 / 11.22		
JHF-19	12.95	12.55	10.37	9.37	8.55	7.85	7.49	7.19	6.89	6.49 / 10.50		
JHF-20	13.11	12.65	10.46	9.43	8.56	7.89	7.51	7.21	6.92	6.62 / 10.65		
JHF-21	13.38	12.91	10.63	9.57	8.66	8.00	7.54	7.23	6.96	6.96 / 11.01		
JHF-22	13.64	12.88	10.62	9.57	8.66	7.93	7.55	7.22	6.96	6.96 / 11.14		
JHF-23	13.97	13.31	10.99	9.85	8.86	8.09	7.59	7.21	6.98	7.49 / 11.60		
JHF-24	13.89	13.14	10.76	9.68	8.75	7.99	7.59	7.27	6.98	7.11 / 11.47		
JHF-25	13.81	13.06	10.70	9.64	8.73	7.94	7.58	7.26	6.98	7.35 / 11.31		
JHF-26	14.13	13.32	10.82	9.76	8.78	8.07	7.64	7.29	7.03	7.53 / 11.36		
JHF-27	13.95	13.08	10.58	9.59	8.73	8.05	7.64	7.30	7.01	6.98 / 11.17		
JHF-28	13.36	12.77	10.13	9.32	8.43	7.92	7.64	7.27	6.96	6.38 / 10.58		
JHF-29	13.19	12.59	10.04	9.25	8.38	7.91	7.62	7.24	6.95	6.29 / 10.40		
JHF-30	12.89	12.17	9.78	9.08	8.29	7.90	7.62	7.22	6.94	6.22 / 10.16		
JHF-31	12.75	12.00	9.75	9.00	8.25	7.90	7.64	7.21	6.95	6.11 / 9.98		
JHF-32	12.95	12.31	9.82	9.07	8.36	7.97	7.67	7.26	6.99	6.24 / 10.31		
JHF-33	12.77	11.84	9.72	8.99	8.27	7.93	7.66	7.22	6.96	6.05 / 10.02		
JHF-34	12.83	11.85	9.75	9.02	8.33	7.95	7.66	7.24	6.98	6.04 / 10.19		
JHF-35	11.73	10.55	8.94	8.29	8.02	7.74	7.28	6.92	6.67	5.65 / 9.14		
JHF-36	11.50	10.34	8.83	8.21	7.98	7.71	7.25	6.91	6.69	5.61 / 9.05		
JHF-37	11.51	10.39	8.85	8.17	7.98	7.72	7.27	6.93	6.69	5.69 / 9.14		
JHF-38	11.27	10.33	8.70	8.14	7.95	7.67	7.22	6.90	6.68	5.55 / 9.05		
JHF-39	10.95	10.09	8.56	8.13	7.93	7.63	7.19	6.89	6.72	5.42 / 8.95		
JHF-40	10.61	9.86	8.44	8.11	7.92	7.78	7.15	6.87	6.76	5.31 / 8.82		
JHF-41	10.36	9.65	8.34	8.09	7.89	7.48	7.13	6.86	6.76	5.22 / 8.73		
JHF-42	9.97	9.24	8.19	8.06	7.76	7.43	7.09	6.87	6.81	5.14 / 8.64		
JHF-43	10.16	9.41	8.26	8.09	7.87	7.46	7.14	6.89	6.83	5.18 / 8.68		
JHF-44	10.17	9.43	8.31	8.14	7.74	7.52	7.17	6.95	6.89	5.10 / 8.69		
JHF-45	10.63	9.74	8.37	8.15	7.82	7.59	7.23	6.97	6.90	5.35 / 8.78		
GHLC-1	12.32	12.31	11.39	9.88	8.14	6.60	5.80	4.84	4.49	4.44 / 10.30		
GHLC-2	11.88	11.87	11.27	9.80	7.93	6.70	5.99	4.96	4.54	4.91 / 10.04		
GHLC-3	11.74	11.72	10.81	9.26	7.77	6.61	5.89	4.96	4.55	5.30 / 9.78		
GHLC-4	12.45	12.45	11.34	9.56	7.92	6.65	6.01	5.14	4.73	5.73 / 9.78		
GHLC-5	12.44	12.44	11.35	9.67	8.07	6.72	6.03	5.07	4.80	5.65 / 9.48		
GHLC-6	12.29	12.29	11.35	9.63	8.23	6.81	6.12	5.19	4.91	6.00 / 9.59		

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・ハークレイズ・キャピタル、UBS、メルリッチ日本、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		
GHLC-7	12.32	11.89	11.36	9.46	8.21	6.71	5.99	5.13	4.93	6.00 /	9.27
GHLC-8	12.24	12.24	10.99	9.40	8.00	6.72	6.05	5.22	4.99	6.16 /	9.32
GHLC-9	12.08	11.68	10.57	8.93	7.59	6.68	5.97	5.22	5.04	6.16 /	9.29
GHLC-10	11.99	11.78	10.38	8.71	7.42	6.61	5.96	5.28	5.05	6.20 /	9.01
GHLC-11	11.77	11.77	10.09	8.46	7.26	6.60	6.09	5.36	5.18	6.12 /	9.28
GHLC-12	11.47	11.47	9.78	8.24	7.13	6.60	6.09	5.39	5.26	5.80 /	8.71
GHLC-13	11.54	11.31	9.84	8.27	7.21	6.66	6.10	5.48	5.29	5.73 /	9.16
GHLC-14	11.62	11.49	9.97	8.40	7.26	6.69	6.12	5.42	5.23	5.92 /	8.91
GHLC-15	11.64	11.53	9.84	8.32	7.21	6.69	6.14	5.45	5.30	5.80 /	8.89
GHLC-16	11.48	11.48	9.79	8.24	7.19	6.61	6.09	5.44	5.29	5.77 /	8.88
GHLC-17	11.57	11.43	9.79	8.30	7.24	6.71	6.19	5.47	5.34	5.80 /	8.88
GHLC-18	11.45	11.22	9.66	8.26	7.30	6.68	6.20	5.50	5.40	6.07 /	8.67
GHLC-19	11.34	11.34	9.61	8.21	7.28	6.62	6.20	5.48	5.44	5.96 /	8.58
GHLC-20	11.34	11.34	9.66	8.28	7.33	6.73	6.31	5.62	5.53	5.96 /	8.78
GHLC-21	11.20	11.12	9.61	8.27	7.34	6.83	6.29	5.66	5.57	5.93 /	8.70
GHLC-22	11.23	11.19	9.70	8.29	7.32	6.82	6.20	5.69	5.54	6.06 /	8.94
GHLC-23	11.32	10.82	9.70	8.28	7.37	6.84	6.24	5.71	5.60	6.03 /	8.95
GHLC-24	11.22	10.89	9.70	8.30	7.40	6.86	6.24	5.75	5.67	6.00 /	8.94
GHLC-25	10.97	10.74	9.62	8.04	7.34	6.93	6.29	5.80	5.67	5.97 /	8.97
GHLC-26	10.73	10.58	9.39	8.15	7.27	6.72	6.25	5.71	5.62	5.73 /	8.51
GHLC-27	10.19	10.19	8.85	7.72	7.26	6.75	6.26	5.93	5.61	5.37 /	8.80
GHLC-28	10.82	10.71	9.33	7.90	7.30	6.77	6.28	5.84	5.67	5.69 /	8.79
GHLC-29	10.30	10.07	8.72	7.73	7.27	6.65	6.24	5.93	5.56	5.31 /	8.89
GHLC-30	10.28	9.86	8.43	7.68	7.23	6.61	6.21	5.90	5.56	5.31 /	8.99
GHLC-31	10.13	9.71	8.25	7.53	7.22	6.63	6.28	5.87	5.45	5.18 /	8.77
GHLC-32	10.13	9.55	8.19	7.50	7.17	6.68	6.28	5.83	5.47	5.12 /	8.70
GHLC-33	10.37	9.88	8.42	7.67	7.23	6.67	6.34	5.89	5.47	5.18 /	8.85
GHLC-34	10.44	9.67	8.23	7.61	7.18	6.62	6.28	5.84	5.45	5.10 /	8.76
GHLC-35	10.36	9.83	8.29	7.62	7.20	6.61	6.28	5.84	5.45	5.16 /	8.82
GHLC-36	10.66	10.40	8.78	7.89	7.33	6.70	6.30	5.93	5.52	5.46 /	9.08
GHLC-37	11.12	10.29	8.60	7.85	7.34	6.69	6.32	5.91	5.51	5.38 /	9.02
GHLC-38	11.36	10.32	9.07	8.04	7.40	6.88	6.35	5.95	5.55	5.63 /	9.24
GHLC-39	11.22	10.50	8.79	7.93	7.38	6.83	6.31	5.94	5.53	5.47 /	8.95
GHLC-40	11.22	10.77	9.20	8.06	7.45	6.93	6.38	5.97	5.55	5.81 /	9.21
GHLC-41	10.66	10.38	8.68	7.93	7.39	6.80	6.32	5.94	5.57	5.56 /	9.00
GHLC-42	11.28	10.77	9.14	8.10	7.43	6.87	6.35	6.00	5.61	5.86 /	9.22
GHLC-43	11.60	10.90	9.60	8.29	7.51	6.99	6.42	6.00	5.65	6.09 /	9.44
GHLC-44	12.50	11.39	10.01	8.63	7.71	7.08	6.51	6.05	5.72	6.42 /	9.77
GHLC-45	11.85	11.48	9.79	8.47	7.64	7.07	6.45	6.00	5.65	6.25 /	9.54
GHLC-46	11.86	11.71	9.86	8.55	7.71	7.08	6.54	5.98	5.67	6.31 /	9.60
GHLC-47	12.22	11.75	9.89	8.55	7.71	7.07	6.54	6.00	5.66	6.29 /	9.54
GHLC-48	11.58	11.29	9.38	8.25	7.57	6.92	6.37	5.99	5.60	5.91 /	9.15
GHLC-49	11.61	11.13	9.36	8.21	7.57	6.95	6.36	5.97	5.59	5.87 /	9.10
GHLC-50	12.29	11.70	9.82	8.55	7.74	7.11	6.51	5.98	5.65	6.26 /	9.46
GHLC-51	11.84	11.39	9.61	8.31	7.65	6.95	6.40	5.99	5.59	5.97 /	9.15
GHLC-52	11.20	11.28	9.23	8.19	7.55	6.83	6.34	5.96	5.59	5.81 /	8.97
GHLC-53	11.66	11.28	9.45	8.32	7.60	6.85	6.38	6.02	5.64	5.93 /	9.08
JHF-S1	11.73	11.73	10.48	9.23	7.88	6.80	6.10	5.39	5.11	6.77 /	9.46
JHF-S2	11.66	11.66	10.48	9.22	7.90	6.82	6.14	5.40	5.11	6.76 /	9.28
JHF-S3	11.55	11.55	10.53	9.24	7.95	6.78	6.18	5.42	5.12	6.79 /	9.36
JHF-S4	11.49	11.49	10.17	8.93	7.55	6.58	6.12	5.49	5.31	6.39 /	9.06
JHF-S5	11.33	11.33	9.97	8.71	7.36	6.55	6.07	5.51	5.37	6.17 /	8.82
JHF-S6	11.34	11.29	10.02	8.70	7.42	6.58	6.09	5.51	5.39	6.18 /	8.85
JHF-S7	11.29	11.29	9.99	8.68	7.41	6.56	6.10	5.50	5.37	6.14 /	8.74
JHF-S8	10.81	10.81	9.25	8.43	7.17	6.47	6.07	5.64	5.54	5.68 /	8.28

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・ハークレイズ・キャピタル、UBS、メルリッチ日本、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-S9	10.80	10.80	9.26	8.40	7.16	6.48	6.06	5.66	5.54	5.69 / 8.43	
JHF-S10	10.45	10.34	8.90	8.14	7.38	6.74	6.20	5.89	5.68	5.45 / 8.18	
JHF-S11	11.26	10.53	9.30	8.26	7.43	7.00	6.26	5.98	5.80	5.75 / 8.86	
JHF-S12	11.71	10.83	9.44	8.28	7.49	7.05	6.41	6.09	5.82	5.87 / 9.10	
JHF-S13	7.22	7.21	7.14	6.14	5.69	5.16	4.68	4.04	3.47	2.83 / 8.56	
JHF-S14	7.24	7.24	7.12	6.15	5.70	5.18	4.72	4.01	3.49	2.81 / 8.63	
JHF-S15	7.25	7.24	7.15	6.14	5.69	5.18	4.76	4.03	3.46	2.80 / 8.54	
JHF-S16	7.66	7.53	7.50	6.46	5.96	5.50	5.03	4.21	3.65	3.17 / 8.61	
JHF-S17	7.67	7.56	7.50	6.44	5.98	5.48	4.95	4.21	3.65	3.10 / 8.53	
JHF-S18	7.69	7.58	7.53	6.49	6.12	5.50	5.01	4.21	3.65	3.09 / 8.49	
GHLC-S1	11.58	11.48	10.35	9.10	7.59	6.60	5.86	5.02	4.76	6.34 / 9.72	
GHLC-S2	11.52	11.40	10.26	8.97	7.56	6.53	5.90	5.01	4.75	6.41 / 9.63	
GHLC-S3	11.57	11.49	10.23	9.11	7.63	6.65	5.95	5.01	4.77	6.43 / 9.59	
GHLC-S4	11.34	11.34	10.32	9.07	7.62	6.65	5.99	5.17	4.88	6.59 / 9.91	
GHLC-S5	11.37	11.37	10.29	9.06	7.59	6.61	6.00	5.13	4.91	6.66 / 9.82	
GHLC-S6	11.76	11.76	10.55	9.14	7.81	6.78	6.15	5.25	5.00	6.82 / 9.74	
GHLC-S7	11.63	11.63	10.53	9.15	7.81	6.78	6.06	5.26	4.99	6.86 / 9.63	
GHLC-S8	11.66	11.66	10.52	9.19	7.81	6.80	6.12	5.23	4.97	6.87 / 9.61	
GHLC-S9	11.65	11.65	10.50	9.17	7.84	6.80	6.11	5.23	4.95	6.90 / 9.49	
GHLC-S10	11.63	11.63	10.47	9.19	7.85	6.85	6.14	5.25	4.97	6.87 / 9.58	

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。